

华宝量化对冲策略混合型发起式证券投资
基金
2022 年中期报告

2022 年 6 月 30 日

基金管理人：华宝基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：2022 年 8 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 08 月 29 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中的财务资料未经审计。

本报告期自 2022 年 01 月 01 日起至 2022 年 06 月 30 日止。

1.2 目录

| | |
|---|-----------|
| § 1 重要提示及目录 | 2 |
| 1.1 重要提示 | 2 |
| 1.2 目录 | 3 |
| § 2 基金简介 | 5 |
| 2.1 基金基本情况 | 5 |
| 2.2 基金产品说明 | 5 |
| 2.3 基金管理人和基金托管人 | 5 |
| 2.4 信息披露方式 | 6 |
| 2.5 其他相关资料 | 6 |
| § 3 主要财务指标和基金净值表现 | 6 |
| 3.1 主要会计数据和财务指标 | 6 |
| 3.2 基金净值表现 | 7 |
| § 4 管理人报告 | 9 |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况 | 9 |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明 | 12 |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 | 12 |
| 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明 | 12 |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 | 13 |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 | 13 |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 | 14 |
| 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明 | 14 |
| § 5 托管人报告 | 14 |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 | 14 |
| 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 | 15 |
| 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见 | 15 |
| § 6 半年度财务会计报告（未经审计） | 15 |
| 6.1 资产负债表 | 15 |
| 6.2 利润表 | 16 |
| 6.3 净资产（基金净值）变动表 | 18 |
| 6.4 报表附注 | 21 |
| § 7 投资组合报告 | 49 |
| 7.1 期末基金资产组合情况 | 49 |
| 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 | 50 |
| 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细 | 50 |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 | 58 |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 | 60 |
| 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细 | 60 |
| 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 | 60 |
| 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细 | 60 |

| | |
|--|-----------|
| 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 | 60 |
| 7.10 本基金投资股指期货的投资政策 | 60 |
| 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 | 61 |
| 7.12 市场中性策略执行情况 | 61 |
| 7.13 投资组合报告附注 | 61 |
| § 8 基金份额持有人信息 | 62 |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 | 62 |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 | 62 |
| 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 | 62 |
| 8.4 发起式基金发起资金持有份额情况 | 63 |
| § 9 开放式基金份额变动 | 63 |
| § 10 重大事件揭示 | 64 |
| 10.1 基金份额持有人大会决议 | 64 |
| 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 | 64 |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 | 64 |
| 10.4 基金投资策略的改变 | 64 |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 | 64 |
| 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 | 64 |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 | 65 |
| 10.8 其他重大事件 | 67 |
| § 11 影响投资者决策的其他重要信息 | 68 |
| 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 | 68 |
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息 | 69 |
| § 12 备查文件目录 | 69 |
| 12.1 备查文件目录 | 69 |
| 12.2 存放地点 | 69 |
| 12.3 查阅方式 | 69 |

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | | |
|-----------------|----------------------|------------------|
| 基金名称 | 华宝量化对冲策略混合型发起式证券投资基金 | |
| 基金简称 | 华宝量化对冲混合 | |
| 基金主代码 | 000753 | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | |
| 基金合同生效日 | 2014 年 9 月 17 日 | |
| 基金管理人 | 华宝基金管理有限公司 | |
| 基金托管人 | 中国银行股份有限公司 | |
| 报告期末基金份额总额 | 481,671,539.90 份 | |
| 基金合同存续期 | 不定期 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 华宝量化对冲混合 A | 华宝量化对冲混合 C |
| 下属分级基金的交易代码 | 000753 | 000754 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 194,670,738.88 份 | 287,000,801.02 份 |

2.2 基金产品说明

| | |
|--------|--|
| 投资目标 | 在有效控制风险的基础上，运用股指期货等衍生工具对冲市场系统风险，追求基金资产的长期稳健增值。 |
| 投资策略 | 在资产配置方面，本基金主要运用股指期货等空头工具对持有的股票等权益类多头组合进行对冲操作，规避权益类多头组合的市场系统性风险；同时预留必要的现金，以应对保证金的增加要求或投资者的赎回申请。股票方面，本基金主要采用量化行业配置模型和量化 Alpha 选股模型构建指数增强股票组合，严格控制运作风险，并根据市场变化趋势，定期对模型进行调整，以改进模型的有效性，最大化超额收益。 |
| 业绩比较基准 | 一年期银行定期存款利率（税后） |
| 风险收益特征 | 本基金为特殊类型的混合型基金，主要采用追求绝对收益的市场中性策略，与股票市场表现的相关性较低。相对股票型基金和一般的混合型基金，其预期风险较小。本基金实际的收益和风险主要取决于基金投资策略的有效性，因此收益不一定能超越业绩比较基准。 |

2.3 基金管理人和基金托管人

| 项目 | | 基金管理人 | 基金托管人 |
|---------|------|---------------------------|----------------------|
| 名称 | | 华宝基金管理有限公司 | 中国银行股份有限公司 |
| 信息披露负责人 | 姓名 | 周雷 | 许俊 |
| | 联系电话 | 021-38505888 | 95566 |
| | 电子邮箱 | xxpl@fsfund.com | fcid@bankofchina.com |
| 客户服务电话 | | 400-700-5588、400-820-5050 | 95566 |

| | | |
|-------|--------------------------------------|------------------|
| 传真 | 021-38505777 | 010-66594942 |
| 注册地址 | 中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 100 号上海环球金融中心 58 楼 | 北京市西城区复兴门内大街 1 号 |
| 办公地址 | 中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 100 号上海环球金融中心 58 楼 | 北京市西城区复兴门内大街 1 号 |
| 邮政编码 | 200120 | 100818 |
| 法定代表人 | XIAOYI HELEN HUANG | 刘连舸 |

2.4 信息披露方式

| | |
|---------------------|----------------|
| 本基金选定的信息披露报纸名称 | 证券时报 |
| 登载基金中期报告正文的管理人互联网网址 | www.fsfund.com |
| 基金中期报告备置地点 | 基金管理人及基金托管人住所 |

2.5 其他相关资料

| 项目 | 名称 | 办公地址 |
|--------|-------|--------------------------------------|
| 注册登记机构 | 基金管理人 | 中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 100 号上海环球金融中心 58 楼 |

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

| 3.1.1 期间数据和指标 | 报告期(2022 年 01 月 01 日-2022 年 06 月 30 日) | |
|---------------|--|---------------|
| | 华宝量化对冲混合 A | 华宝量化对冲混合 C |
| 本期已实现收益 | 537,777.47 | -203,163.12 |
| 本期利润 | -5,428,696.74 | -8,199,690.48 |
| 加权平均基金份额本期利润 | -0.0216 | -0.0213 |
| 本期加权平均净值利润率 | -1.86% | -1.88% |
| 本期基金份额净值增长率 | -1.54% | -1.73% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2022 年 6 月 30 日) | |

| | | |
|--------------|------------------|----------------|
| 期末可供分配利润 | 29,498,150.37 | 36,604,771.48 |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.1515 | 0.1275 |
| 期末基金资产净值 | 224,168,889.25 | 323,605,572.50 |
| 期末基金份额净值 | 1.1515 | 1.1275 |
| 3.1.3 累计期末指标 | 报告期末(2022年6月30日) | |
| 基金份额累计净值增长率 | 41.49% | 38.58% |

注：1. 本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润等于本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2. 所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3. 净值相关数据计算中涉及天数的，包括所有交易日以及季末最后一自然日（如非交易日）。

4. 期末可供分配利润采用资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

华宝量化对冲混合 A

| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|-------|----------|-------------|------------|---------------|--------|-------|
| 过去一个月 | 0.32% | 0.37% | 0.12% | 0.00% | 0.20% | 0.37% |
| 过去三个月 | -1.02% | 0.32% | 0.37% | 0.00% | -1.39% | 0.32% |
| 过去六个月 | -1.54% | 0.30% | 0.74% | 0.01% | -2.28% | 0.29% |
| 过去一年 | -2.48% | 0.31% | 1.50% | 0.00% | -3.98% | 0.31% |

| | | | | | | |
|----------------|--------|-------|--------|-------|--------|-------|
| 过去三年 | 13.37% | 0.27% | 4.50% | 0.00% | 8.87% | 0.27% |
| 自基金合同生效 起至今 | 41.49% | 0.28% | 12.71% | 0.01% | 28.78% | 0.27% |

华宝量化对冲混合 C

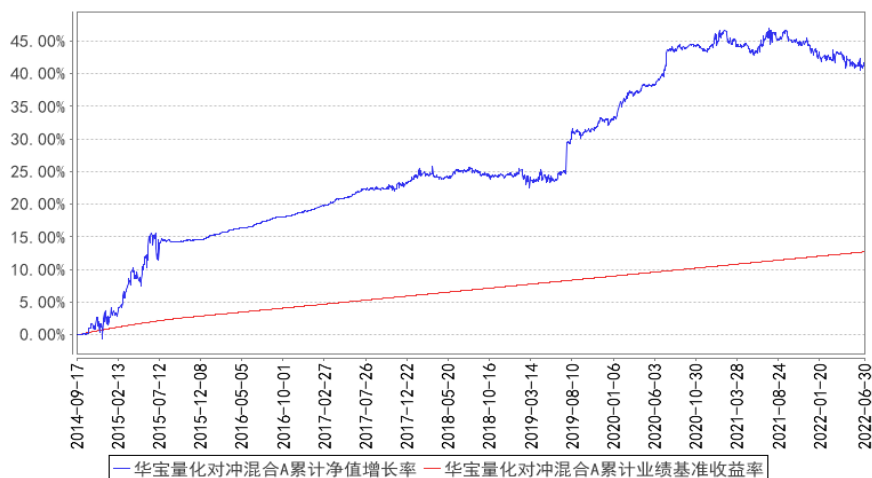
| 阶段 | 份额净值 增长率① | 份额净值 增长率标 准差② | 业绩比较 基准收益 率③ | 业绩比较基准 收益率标准 差④ | ①-③ | ②-④ |
|----------------|--------------|---------------------|--------------------|-----------------------|--------|-------|
| 过去一个月 | 0.28% | 0.37% | 0.12% | 0.00% | 0.16% | 0.37% |
| 过去三个月 | -1.12% | 0.32% | 0.37% | 0.00% | -1.49% | 0.32% |
| 过去六个月 | -1.73% | 0.30% | 0.74% | 0.01% | -2.47% | 0.29% |
| 过去一年 | -2.88% | 0.31% | 1.50% | 0.00% | -4.38% | 0.31% |
| 过去三年 | 12.01% | 0.27% | 4.50% | 0.00% | 7.51% | 0.27% |
| 自基金合同生效 起至今 | 38.58% | 0.28% | 12.71% | 0.01% | 25.87% | 0.27% |

注：（1）基金业绩基准：一年期银行定期存款利率（税后）；

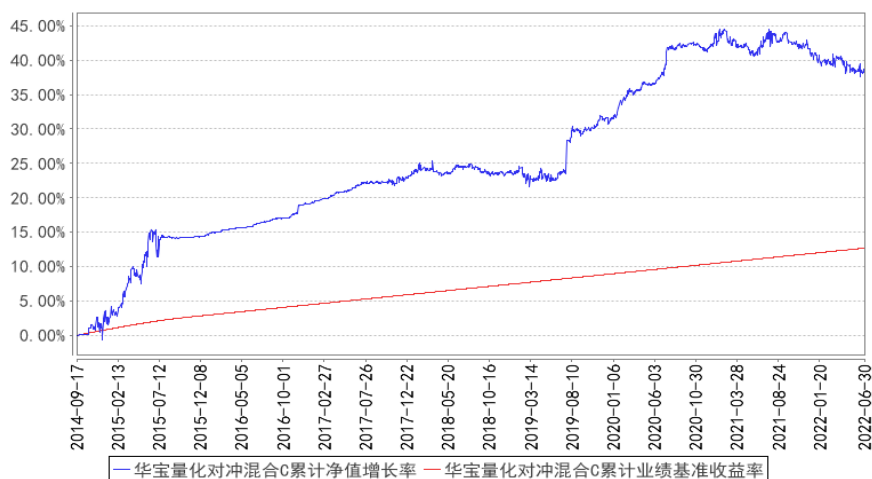
（2）净值以及比较基准相关数据计算中涉及天数的，包括所有交易日以及季末最后一自然日（如非交易日）。

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

华宝量化对冲混合A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



华宝量化对冲混合C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：按照基金合同的约定，基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定，截至 2015 年 03 月 17 日，本基金已达到合同规定的资产配置比例。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

华宝基金管理有限公司（公司原名“华宝兴业基金管理有限公司”）于 2003 年 2 月 12 日经中国证监会批准设立，2003 年 3 月 7 日在国家工商总局注册登记并正式开业，是国内首批中外合资基金管理公司。成立之初，公司注册资本为人民币 1 亿元人民币，2007 年经中国证监会批准，公司注册资本增加至 1.5 亿元人民币。2017 年公司名称变更为“华宝基金管理有限公司”。目前公司股东为华宝信托有限责任公司、美国华平资产管理有限合伙（Warburg Pincus Asset Management, L.P.）和江苏省铁路集团有限公司，持有股权占比分别

为 51%、29%、20%。公司在北京、深圳等地设有分公司，在香港设有子公司——华宝资产管理（香港）有限公司。

截至本报告期末（2022 年 06 月 30 日），本公司正在管理运作的证券投资基金包括：华宝宝康债券投资基金、华宝宝康消费品证券投资基金、华宝宝康灵活配置证券投资基金、华宝现金货币市场基金、华宝动力组合混合型证券投资基金、华宝先进成长混合型证券投资基金、华宝行业精选混合型证券投资基金、华宝海外中国成长混合型证券投资基金、华宝大盘精选混合型证券投资基金、华宝增强收益债券型证券投资基金、华宝中证 100 指数证券投资基金、华宝可转债债券型证券投资基金、华宝标普石油天然气上游股票指数证券投资基金 (LOF)、华宝资源优选混合型证券投资基金、华宝现金添益交易型货币市场基金、华宝创新优选混合型证券投资基金、华宝量化对冲策略混合型发起式证券投资基金、华宝标普美国品质消费股票指数证券投资基金 (LOF)、华宝标普香港上市中国中小盘指数证券投资基金 (LOF)、华宝中证军工交易型开放式指数证券投资基金、华宝中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金、华宝标普中国 A 股红利机会指数证券投资基金 (LOF)、华宝中证银行交易型开放式指数证券投资基金、华宝绿色主题混合型证券投资基金、华宝稳健养老目标一年持有期混合型发起式基金中基金 (FOF)、华宝中证医疗交易型开放式指数证券投资基金、华宝中证科技龙头交易型开放式指数证券投资基金、华宝 MSCI 中国 A 股国际通 ESG 通用指数证券投资基金 (LOF)、华宝中证科技龙头交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、华宝浮动净值型发起式货币市场基金、华宝致远混合型证券投资基金 (QDII)、华宝中证消费龙头指数证券投资基金 (LOF)、华宝中证电子 50 交易型开放式指数证券投资基金、华宝中证科创创业 50 交易型开放式指数证券投资基金、华宝中证大数据产业交易型开放式指数证券投资基金等，共 128 只基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理（助理）期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|-----|-------------------------|-----------------|------|--------|--|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 徐林明 | 本基金基金经理、量化投资总监、量化投资部总经理 | 2014-09-17 | - | 20 年 | 硕士。曾在兴业证券、凯龙财经（上海）有限公司、中原证券从事金融工程研究工作。2005 年 8 月加入华宝基金管理有限公司，先后担任金融工程部数量分析师、金融工程部副总经理等职务，现任量化投资总监、量化投资部总经理。2009 年 9 月至 2015 年 11 月任华宝中证 100 指数证券投资基金基金经理，2010 年 4 月至 2015 年 11 月任上证 180 价值交易型开放式指数证券投资基金、华宝上证 180 价值交易型开放式指数 |

| | | | | | |
|-----|------------|------------|---|------|---|
| | | | | | 证券投资基金联接基金基金经理，2014 年 9 月起任华宝量化对冲策略混合型发起式证券投资基金基金经理，2015 年 4 月至 2020 年 2 月任华宝事件驱动混合型证券投资基金基金经理，2016 年 12 月起任华宝沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金基金经理，2019 年 2 月起任华宝科技先锋混合型证券投资基金基金经理，2021 年 12 月起任华宝中证稀有金属主题指数增强型发起式证券投资基金基金经理。 |
| 王正 | 本基金经理 | 2020-01-02 | - | 10 年 | 硕士。2012 年 7 月加入华宝基金管理有限公司，先后担任助理量化分析师、分析师、基金经理助理等职务。2020 年 1 月起任华宝沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金、华宝量化对冲策略混合型发起式证券投资基金基金经理，2021 年 1 月起任华宝智慧产业灵活配置混合型证券投资基金、华宝第三产业灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2021 年 1 月至 2022 年 7 月任华宝中证 500 指数增强型发起式证券投资基金基金经理，2021 年 6 月起任华宝安盈混合型证券投资基金基金经理。 |
| 唐雪倩 | 本基金的基金经理助理 | 2018-01-23 | - | 7 年 | 2015 年 7 月加入华宝基金管理有限公司，先后担任分析师、基金经理助理等职务。2018 年 1 月至 2018 年 6 月任华宝新动力一年定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理，2018 年 1 月至 2018 年 7 月任华宝新回报一年定期开放混合型证券投资基金基金经理助理，2018 年 1 月至 2018 年 8 月任华宝新优选一年定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理，2018 年 1 月起任华宝量化对冲策略混合型发起式证券投资基金、华宝沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金、华宝新价值灵活配置混合型证券投资基金、华宝新机遇灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、华宝新起点灵活配置混合型证券投资基金、华宝新飞跃灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理，2019 年 2 月起任华宝科技先锋混合型证券投资基金基金经理助理，2019 年 7 月起任华宝新活力灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理，2021 年 8 月至 2021 年 10 月任华宝安享混合型证券投资基金基金经理助理，2021 年 9 月至 2021 年 10 月任华宝安益混 |

| | | | | | |
|--|--|--|--|--|--|
| | | | | | 合型证券投资基金基金经理助理。2021 年 10 月至 2022 年 6 月任华宝安益混合型证券投资基金基金经理，2021 年 10 月起任华宝安享混合型证券投资基金基金经理，2022 年 6 月起任华宝红利精选混合型证券投资基金基金经理。 |
|--|--|--|--|--|--|

注：1、任职日期以及离任日期均以基金公告为准。

2、证券从业含义遵从《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

本报告期内，本基金基金经理未兼任私募资产管理计划投资经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项实施细则、《华宝量化对冲策略混合型发起式证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定、监管部门的相关规定，依照诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋取最大利益，没有损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，基金管理人通过严格执行投资决策委员会议事规则、公司股票库管理制度、中央交易室制度、防火墙机制、系统中的公平交易程序、每日交易日结报告、定期基金投资绩效评价等机制，确保所管理的所有投资组合在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动和环节得到公平对待。同时，基金管理人严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定和公司内部制度要求，分析了本公司旗下所有投资组合之间的整体收益率差异、分投资类别（股票、债券）的收益率差异以及连续四个季度期间内、不同时间窗下同向交易的交易价差；分析结果未发现异常情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，基金管理人未发生所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%。

本报告期内，本基金未发现异常交易行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

回顾 2022 年上半年，全球各主要经济体通胀高企、原油等大宗商品价格走高，美联储较为鹰

派地推进加息并释放紧缩信号，使得投资者风险偏好下降，全球股票市场普遍下跌，而 A 股呈现出先跌后涨、行业结构分化的特点。1-4 月受全球宏观环境恶化的影响，A 股亦走势低迷，相对来说稳增长和低估值板块更为抗跌。5-6 月，国内经济情况边际好转、流动性相对宽松，美元指数见顶回落、通胀边际好转等因素使得市场整体上行，前期超跌的成长在这一阶段表现更优。整体来看，上半年以煤炭为代表的通胀主题和以房地产为代表的稳增长板块以及以汽车、电气设备为代表的新能源均有表现，而 TMT 板块跌幅居前。

本报告期，基金仍然坚持稳健的市场中性投资策略，选股方面沿用此前的量化 Alpha 多因子选股模型，精选估值和业绩相匹配、基本面优质、经营稳健、具有核心竞争力的标的并利用股指期货对股票组合进行对冲，剥离系统性风险。由于年内市场风格切换带来因子持续性的扰动以及对冲成本的存在，基金获取绝对收益的难度有所提高，但随着中证 1000 股指期货 IM 的上市，丰富了基金的对冲工具，有望扩大基金的收益来源。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期基金份额 A 净值增长率为-1.54%，本报告期基金份额 C 净值增长率为-1.73%；同期业绩比较基准收益率为 0.74%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，国内的经济复苏存在诸多有利条件，经济最困难的时期已经过去，随着疫情冲击的消退，稳增长成为宏观政策的主基调，政策面仍然会保持呵护托底。但复苏仍可能面临一定的挑战，一是国际局势动荡加剧，国家间的摩擦可能增多；二是内需的释放和产业的升级仍需更大政策力度的推动；三是全球滞涨格局下国内 PPI 向 CPI 传导的可能性。

尽管下半年仍然存在一定的扰动因素，但 A 股经过前期较为充分的风险释放，估值已回归到相对有吸引力的水平。从长周期来看，在不确定的环境下，估值有安全边际、经营稳健、基本面优质、有核心竞争力的公司仍有较高的配置价值，有望取得长期稳定的相对收益。基金将继续关注符合常识和逻辑的因子，在投资过程中注重对个股基本面质地的考察，利用量化模型甄选出具备良好经营能力、估值与成长匹配的优质公司，并坚持市场中性的投资风格，争取为投资者创造好的投资收益。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。

本基金管理人设有估值委员会，定期评价现行估值政策和程序，在发生了影响估值政策和程序的有效性及其适用性的情况后及时修订估值方法。基金在投资新品种时，由估值委员会评价现有

估值政策和程序的适用性。

(1) 日常估值流程

本基金的估值由基金会计负责，基金会计以本基金为会计核算主体，基金会计核算独立于公司会计核算，独立建账、独立核算。基金会计采用专用的财务核算软件系统进行基金核算及帐务处理；每日按时接收成交数据及权益数据，进行基金估值。基金会计核算采用基金管理人与托管银行双人同步独立核算、相互核对的方式进行；基金会计每日就基金的会计核算、基金估值等与托管银行进行核对，每日估值结果必须与托管行核对一致后才能对外公告。

(2) 特殊业务估值流程

根据中国证券监督管理委员会[2017]13 号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、中国证券投资基金业协会《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数通知》、《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》、《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》等有关规定及本公司的估值制度，对特殊品种或由于特殊原因导致投资品种不存在活跃市场的情况，量化投资部根据估值委员会确定的对停牌股票或异常交易股票估值调整的方法（比如：指数收益法）进行估值，并兼顾行业研究员基于上市公司估值模型计算结果所提出的估值建议或意见。必要时基金经理也会就估值模型及估值方法的确定提出建议和意见，但由估值委员会做最终决策。

上述参与估值流程的人员均具备估值业务所需的专业胜任能力，参与估值流程各方之间不存在重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期亏损，未有应分未分的利润。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内，本基金不存在连续二十个工作日基金份额持有人低于二百人或基金资产净值低于五千万元的情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在华宝量化对冲策略混合型发起式证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”、“关联方承销证券”、“关联方证券出借”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：华宝量化对冲策略混合型发起式证券投资基金

报告截止日：2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资产 | 附注号 | 本期末 2022 年 6 月 30 日 | 上年度末 2021 年 12 月 31 日 |
|------------|---------|------------------------|--------------------------|
| 资产： | | | |
| 银行存款 | 6.4.7.1 | 2,023,822.61 | 2,977,532.20 |
| 结算备付金 | | 32,196,367.99 | 75,255,486.34 |
| 存出保证金 | | 47,868,654.09 | 87,165,797.54 |
| 交易性金融资产 | 6.4.7.2 | 466,192,179.52 | 792,361,595.35 |
| 其中：股票投资 | | 430,153,046.75 | 735,906,545.35 |
| 基金投资 | | - | - |
| 债券投资 | | 36,039,132.77 | 56,455,050.00 |
| 资产支持证券投资 | | - | - |
| 贵金属投资 | | - | - |
| 其他投资 | | - | - |
| 衍生金融资产 | 6.4.7.3 | - | - |
| 买入返售金融资产 | 6.4.7.4 | 11,615,000.00 | 22,000,000.00 |
| 债权投资 | 6.4.7.5 | - | - |
| 其中：债券投资 | | - | - |
| 资产支持证券投资 | | - | - |
| 其他投资 | | - | - |
| 其他债权投资 | 6.4.7.6 | - | - |
| 其他权益工具投资 | 6.4.7.7 | - | - |
| 应收清算款 | | 9,691,743.12 | 36,239,970.53 |

| | | | |
|---------------|------------|---------------------------|-----------------------------|
| 应收股利 | | - | - |
| 应收申购款 | | 49,884.53 | 87,059.98 |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 6.4.7.8 | - | 1,207,847.31 |
| 资产总计 | | 569,637,651.86 | 1,017,295,289.25 |
| 负债和净资产 | 附注号 | 本期末 2022年6月30日 | 上年度末 2021年12月31日 |
| 负 债: | | | |
| 短期借款 | | - | - |
| 交易性金融负债 | | - | - |
| 衍生金融负债 | 6.4.7.3 | - | - |
| 卖出回购金融资产款 | | - | - |
| 应付清算款 | | 3,161,081.84 | 4,467,487.41 |
| 应付赎回款 | | 13,492,540.46 | 38,729,282.51 |
| 应付管理人报酬 | | 492,998.81 | 1,042,745.77 |
| 应付托管费 | | 98,599.80 | 208,549.15 |
| 应付销售服务费 | | 121,021.82 | 191,204.82 |
| 应付投资顾问费 | | - | - |
| 应交税费 | | 808,202.09 | 27.46 |
| 应付利润 | | - | - |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | 6.4.7.9 | 3,688,745.29 | 3,270,027.66 |
| 负债合计 | | 21,863,190.11 | 47,909,324.78 |
| 净资产: | | | |
| 实收基金 | 6.4.7.10 | 481,671,539.90 | 837,675,246.94 |
| 其他综合收益 | 6.4.7.11 | - | - |
| 未分配利润 | 6.4.7.12 | 66,102,921.85 | 131,710,717.53 |
| 净资产合计 | | 547,774,461.75 | 969,385,964.47 |
| 负债和净资产总计 | | 569,637,651.86 | 1,017,295,289.25 |

注： 1. 报告截止日 2022 年 06 月 30 日，基金份额总额 481,671,539.90 份，其中华宝量化对冲混合 A 基金份额总额 194,670,738.88 份，基金份额净值 1.1515 元；华宝量化对冲混合 C 基金份额总额 287,000,801.02 份，基金份额净值 1.1275 元

2. 以上比较数据已根据本年《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》中的资产负债表格式的要求进行列示：2021 年年度报告资产负债表中“应收利息”与“其他资产”项目的“本期末”余额合并列示在 2022 年中期报告资产负债表中“其他资产”项目的“上年度末”余额，2021 年年度报告资产负债表中“应付交易费用”、“应付利息”与“其他负债”科目的“本期末”余额合并列示在 2022 年中期报告资产负债表“其他负债”项目的“上年度末”余额。

6.2 利润表

会计主体：华宝量化对冲策略混合型发起式证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 附注号 | 本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 |
|------------------------|--------------|--|---|
| 一、营业总收入 | | -8,008,505.25 | 32,491,635.08 |
| 1. 利息收入 | | 1,380,889.26 | 11,595,407.88 |
| 其中：存款利息收入 | 6.4.7.13 | 912,814.69 | 3,306,023.24 |
| 债券利息收入 | | - | 2415010.58 |
| 资产支持证券利息收入 | | - | - |
| 买入返售金融资产收入 | | 468,074.57 | 5,874,374.06 |
| 证券出借利息收入 | | - | - |
| 其他利息收入 | | - | - |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列） | | 4,263,688.19 | -11,896,957.55 |
| 其中：股票投资收益 | 6.4.7.14 | -77,226,152.42 | 86,004,970.03 |
| 基金投资收益 | | - | - |
| 债券投资收益 | 6.4.7.15 | 753,088.76 | 463,488.24 |
| 资产支持证券投资 | 6.4.7.16 | - | - |
| 收益 | | | |
| 贵金属投资收益 | 6.4.7.17 | - | - |
| 衍生工具收益 | 6.4.7.18 | 75,098,514.83 | -110,290,079.37 |
| 股利收益 | 6.4.7.19 | 5,638,237.02 | 11,924,663.55 |
| 以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益 | | - | - |
| 其他投资收益 | | - | - |
| 3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 6.4.7.20 | -13,963,001.57 | 30,562,853.54 |
| 4. 汇兑收益（损失以“-”号填列） | | - | - |
| 5. 其他收入（损失以“-”号填列） | 6.4.7.21 | 309,918.87 | 2,230,331.21 |
| 减：二、营业总支出 | | 5,619,881.97 | 28,983,356.76 |
| 1. 管理人报酬 | 6.4.10.2.1 | 3,631,525.30 | 14,152,456.94 |
| 2. 托管费 | 6.4.10.2.2 | 726,305.13 | 2,830,491.33 |
| 3. 销售服务费 | 6.4.10.2.3 | 871,416.53 | 1,110,826.29 |
| 4. 投资顾问费 | 6.4.10.2.1.1 | - | - |
| 5. 利息支出 | | - | - |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | - | - |

| | | | |
|----------------------------|----------|----------------|---------------|
| 6. 信用减值损失 | 6.4.7.22 | - | - |
| 7. 税金及附加 | | 270,519.65 | 402.76 |
| 8. 其他费用 | 6.4.7.23 | 120,115.36 | 10,889,179.44 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | | -13,628,387.22 | 3,508,278.32 |
| 减：所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | | -13,628,387.22 | 3,508,278.32 |
| 五、其他综合收益的税后净额 | | - | - |
| 六、综合收益总额 | | -13,628,387.22 | 3,508,278.32 |

注：以上比较数据已根据本年《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》中的利润表格式的要求进行列示：2021 年中期报告利润表中“交易费用”项目与“其他费用”项目的“本期”金额合并列示在 2022 年中期报告利润表中“其他费用”项目的“上年度可比期间”金额。

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：华宝量化对冲策略混合型发起式证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 | | | |
|----------------------|---------------------------------------|--------|----------------|-----------------|
| | 实收基金 | 其他综合收益 | 未分配利润 | 净资产合计 |
| 一、上期期末净资产（基金净值） | 837,675,246.94 | - | 131,710,717.53 | 969,385,964.47 |
| 加：会计政策变更 | - | - | - | - |
| 前期差错更正 | - | - | - | - |
| 其他 | - | - | - | - |
| 二、本期期初净资产（基金净值） | 837,675,246.94 | - | 131,710,717.53 | 969,385,964.47 |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列） | -356,003,707.04 | - | -65,607,795.68 | -421,611,502.72 |

| | | | | |
|--|---------------------------------|--------|----------------|------------------|
| (一)、综合收益总额 | - | - | -13,628,387.22 | -13,628,387.22 |
| (二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数 (净值减少以“-”号填列) | -356,003,707.04 | - | -51,979,408.46 | -407,983,115.50 |
| 其中：1. 基金申购款 | 8,663,426.25 | - | 1,217,716.73 | 9,881,142.98 |
| 2. 基金赎回款 | -364,667,133.29 | - | -53,197,125.19 | -417,864,258.48 |
| (三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列) | - | - | - | - |
| (四)、其他综合收益结转留存收益 | - | - | - | - |
| 四、本期期末净资产(基金净值) | 481,671,539.90 | - | 66,102,921.85 | 547,774,461.75 |
| 项目 | 上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日 | | | |
| | 实收基金 | 其他综合收益 | 未分配利润 | 净资产合计 |
| 一、上期期末净资产(基金净值) | 2,715,539,269.24 | - | 469,451,309.48 | 3,184,990,578.72 |
| 加：会计政策变更 | - | - | - | - |

| | | | | |
|--|-----------------------|---|-----------------|-------------------|
| 前期 差错更正 | - | - | - | - |
| 其他 | - | - | - | - |
| 二、本期 期初净资 产（基金 净值） | 2,715,539,269.24 | - | 469,451,309.48 | 3,184,990,578.72 |
| 三、本期 增减变动 额（减少 以“-”号 填列） | - 1,097,025,785.19 | - | -186,045,675.82 | -1,283,071,461.01 |
| （一）、综 合收益总 额 | - | - | 3,508,278.32 | 3,508,278.32 |
| （二）、本 期基金份 额交易产 生的基金 净值变动 数 （净值减 少以“-” 号填列） | - 1,097,025,785.19 | - | -189,553,954.14 | -1,286,579,739.33 |
| 其中：1. 基金申购 款 | 777,878,277.86 | - | 135,016,120.52 | 912,894,398.38 |
| 2. 基金赎回 款 | - 1,874,904,063.05 | - | -324,570,074.66 | -2,199,474,137.71 |
| （三）、本 期向基金 份额持有 人分配利 润产生的 基金净值 变动（净 值减少以 “-”号填 列） | - | - | - | - |
| （四）、其 他综合收 益结转留 存收益 | - | - | - | - |

| | | | | |
|----------------|------------------|---|----------------|------------------|
| 四、本期末净资产（基金净值） | 1,618,513,484.05 | - | 283,405,633.66 | 1,901,919,117.71 |
|----------------|------------------|---|----------------|------------------|

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

| | | |
|-----------|-----------|------------|
| <u>向辉</u> | <u>向辉</u> | <u>张幸骏</u> |
| 基金管理人负责人 | 主管会计工作负责人 | 会计机构负责人 |

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

华宝量化对冲策略混合型发起式证券投资基金(原名为华宝兴业量化对冲策略混合型发起式证券投资基金,以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2014]第 737 号《关于核准华宝兴业量化对冲策略混合型发起式证券投资基金募集的批复》核准,由华宝基金管理有限公司(原华宝兴业基金管理有限公司,已于 2017 年 10 月 17 日办理完成工商变更登记)依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《华宝兴业量化对冲策略混合型发起式证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 606,936,516.77 元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2014)第 536 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《华宝兴业量化对冲策略混合型发起式证券投资基金基金合同》于 2014 年 9 月 17 日生效,基金合同生效日的基金份额总额为 607,038,069.95 份基金份额(A 类基金份额 539,601,058.43 份,C 类基金份额 67,437,011.52 份),其中认购资金利息折合 101,553.18 份基金份额。本基金的基金管理人为华宝基金管理有限公司,基金托管人为中国银行股份有限公司。

根据经批准的《华宝兴业量化对冲策略混合型发起式证券投资基金基金合同》和《华宝兴业量化对冲策略混合型发起式证券投资基金招募说明书》的规定,本基金根据认购费、申购费、销售服务费收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别,即 A 类基金份额和 C 类基金份额。A 类基金份额在投资者认购/申购时收取认购/申购费,但不收取销售服务费;C 类基金份额不收取认购/申购费,而从本类别基金资产中计提销售服务费。A 类基金份额和 C 类基金份额分别设置代码,分别计算和公告基金份额净值和基金份额累计净值。

根据《华宝基金管理有限公司关于旗下基金更名事宜的公告》,华宝兴业量化对冲策略混合型发起式证券投资基金于 2017 年 12 月 30 日起更名为华宝量化对冲策略混合型发起式证券投资基

金。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华宝量化对冲策略混合型发起式证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指期货、存托凭证以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。本基金权益类空头头寸的价值占本基金权益类多头头寸的比例范围在 80%-120%之间。其中：权益类空头头寸的价值是指融券卖出的股票市值、卖出股指期货的合约价值及持有的其他可投资的权益类空头工具价值的合计值；权益类多头头寸的价值是指买入持有的股票市值、买入股指期货的合约价值及持有的其他可投资的权益类多头工具价值的合计值。每个交易日日终，持有的买入期货合约价值和有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 95%。其中：有价证券指股票、债券(不含到期日在一年以内的政府债券)、权证、资产支持证券、买入返售金融资产(不含质押式回购)等。在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，基金保留的现金(不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等)或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准为：一年期银行定期存款利率(税后)。

本财务报表由本基金的基金管理人华宝基金管理有限公司于 2022 年 8 月 31 日批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《华宝量化对冲策略混合型发起式证券投资基金基金合同》和在财务报表附注所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2022 年 6 月 30 日的财务状况以及 2022 年上半年度的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

除下述会计政策外，本报告期所采用的其他会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

新金融工具准则

金融工具，是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产或金融负债。

(1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

债务工具

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种方式进行计量：

以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的业务模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要为债券投资和资产支持证券投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

权益工具

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具(主要为股票投资)按照公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为交易性金融资产。

(2) 金融负债

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

(3) 衍生金融工具

本基金将持有的衍生金融工具以公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为衍生金融资产/负债。

原金融工具准则(截至 2021 年 12 月 31 日前适用的原金融工具准则)

本基金于 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资、债券投资和衍生工具分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括其他各类应付款项等。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

新金融工具准则

金融资产或金融负债在初始确认时以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，确认为应计利息，包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

对于其他各类应收款项，无论是否存在重大融资成分，本基金均按照整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

原金融工具准则(截至 2021 年 12 月 31 日前适用的原金融工具准则)

本基金于 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于

应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

新金融工具准则

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

原金融工具准则(截至 2021 年 12 月 31 日前适用的原金融工具准则)

本基金于 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则

按直线法计算。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

财政部于 2017 年颁布了修订后的《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》、《企业会计准则第 23 号——金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号——套期会计》及《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》（以下合称“新金融工具准则”），财政部、中国银行保险监督管理委员会于 2020 年 12 月 30 日发布了《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》，公募基金证券投资基金自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。此外，中国证监会于 2022 年颁布了修订后的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》，本基金的基金管理人已采用上述准则及通知编制本基金 2022 年度财务报表，对本基金财务报表的影响列示如下：

(a) 金融工具

根据新金融工具准则的相关规定，本基金对于首次执行该准则的累积影响数调整 2022 年年初留存收益以及财务报表其他相关项目金额，2021 年度的比较财务报表未重列。于 2021 年 12 月 31 日及 2022 年 1 月 1 日，本基金均没有指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。

(i) 于 2022 年 1 月 1 日，本财务报表中金融资产和金融负债按照原金融工具准则和新金融工具准则的规定进行分类和计量的结果如下：

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、买入返售金融资产、应收利息、应收证券清算款和应收申购款，金额分别为 2,977,532.20 元、75,255,486.34 元、87,165,797.54 元、22,000,000.00 元、1,207,847.31 元、36,239,970.53 元和 87,059.98 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、买入返售金融资产、其他资产-应收利息、应收清算款和应收申购款，金额分别为 2,978,408.78 元、75,315,623.17 元、87,166,092.12 元、21,996,860.85 元、0.00 元、36,239,970.53 元和 87,059.98 元。

原金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为 792,361,595.35 元。新金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为 793,511,273.82 元。

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付证券清算款、应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费、应付销售服务费、应付交易费用和其他负债-其他应付款，金额分别为 4,467,487.41 元、38,729,282.51 元、1,042,745.77 元、208,549.15 元、191,204.82 元、3,079,986.10 元和 10,041.56 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付清算款、

应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费、应付销售服务费、其他负债-应付交易费用和其他负债-其他应付款，金额分别为 4,467,487.41 元、38,729,282.51 元、1,042,745.77 元、208,549.15 元、191,204.82 元、3,079,986.10 元和 10,041.56 元。

i) 于 2021 年 12 月 31 日，本基金持有的“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等对应的应计利息余额均列示在“应收利息”或“应付利息”科目中。于 2022 年 1 月 1 日，本基金根据新金融工具准则下的计量类别，将上述应计利息分别转入“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等科目项下列示，无期初留存收益影响。

(b) 修订后的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》

根据中国证监会于 2022 年颁布的修订后的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》，本基金的基金管理人在编制本财务报表时调整了部分财务报表科目的列报和披露，这些调整未对本基金财务报表产生重大影响。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期末发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税

的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2022 年 6 月 30 日 |
|----------------|------------------------|
| 活期存款 | 2,023,822.61 |
| 等于：本金 | 2,023,661.98 |
| 加：应计利息 | 160.63 |
| 减：坏账准备 | - |
| 定期存款 | - |
| 等于：本金 | - |
| 加：应计利息 | - |
| 减：坏账准备 | - |
| 其中：存款期限 1 个月以内 | - |
| 存款期限 1-3 个月 | - |
| 存款期限 3 个月以上 | - |
| 其他存款 | - |
| 等于：本金 | - |
| 加：应计利息 | - |

| | |
|--------|--------------|
| 减：坏账准备 | - |
| 合计 | 2,023,822.61 |

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2022年6月30日 | | | |
|---------------|-------------------|---------------|----------------|---------------|
| | 成本 | 应计利息 | 公允价值 | 公允价值变动 |
| 股票 | 411,712,924.87 | - | 430,153,046.75 | 18,440,121.88 |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | - | - | - | - |
| 债券 | 交易所市场 | 48,646.47 | 5,459,146.47 | 5,500.00 |
| | 银行间市场 | 30,282,810.00 | 336,986.30 | -39,810.00 |
| | 合计 | 35,687,810.00 | 385,632.77 | 36,039,132.77 |
| 资产支持证券 | - | - | - | - |
| 基金 | - | - | - | - |
| 其他 | - | - | - | - |
| 合计 | 447,400,734.87 | 385,632.77 | 466,192,179.52 | 18,405,811.88 |

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2022年6月30日 | | | 备注 |
|-----------|-------------------|------|----|----|
| | 合同/名义 金额 | 公允价值 | | |
| | | 资产 | 负债 | |
| 利率衍生工具 | - | - | - | |
| 货币衍生工具 | - | - | - | |
| 权益衍生工具 | -367,643,711.55 | - | - | |
| 其中：股指期货投资 | -367,643,711.55 | - | - | |
| 其他衍生工具 | - | - | - | |
| 合计 | -367,643,711.55 | - | - | |

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

| 代码 | 名称 | 持仓量（买/卖） | 合约市值 | 公允价值变动 |
|----|----|----------|------|--------|
|----|----|----------|------|--------|

| | | | | |
|----------------|--------|---------|-----------------|----------------|
| IC2209 | IC2209 | -40.00 | -50,912,000.00 | 1,451,452.31 |
| IF2207 | IF2207 | -146.00 | -195,926,160.00 | -10,902,908.83 |
| IF2209 | IF2209 | -106.00 | -141,420,960.00 | -11,163,951.93 |
| 合计 | | | | -20,615,408.45 |
| 减：可抵销期货 暂收款 | | | | -20,615,408.45 |
| 净额 | | | | 0.00 |

注：1. 买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

2. 衍生金融资产项下的利率/权益/其他衍生工具为国债/股指/商品期货投资，净额为 0。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持股指/商品/国债期货合约产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的股指/商品/国债期货投资与相关的期货暂收款(结算所得的持仓损益)之间按抵销后的净额为 0。

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2022年6月30日 | |
|-------|-------------------|-----------|
| | 账面余额 | 其中：买断式逆回购 |
| 交易所市场 | 11,615,000.00 | - |
| 银行间市场 | - | - |
| 合计 | 11,615,000.00 | - |

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2022年6月30日 |
|-------------|-------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | - |
| 应付赎回费 | 16.26 |
| 应付证券出借违约金 | - |
| 应付交易费用 | 3,599,468.88 |
| 其中：交易所市场 | 3,599,468.88 |
| 银行间市场 | - |
| 应付利息 | - |
| 预提费用 | 89,260.15 |

| | |
|----|--------------|
| 合计 | 3,688,745.29 |
|----|--------------|

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

华宝量化对冲混合 A

| 项目 | 本期 2022年1月1日至2022年6月30日 | |
|---------------|----------------------------|-----------------|
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 上年度末 | 371,672,758.22 | 371,672,758.22 |
| 本期申购 | 1,950,985.70 | 1,950,985.70 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -178,953,005.04 | -178,953,005.04 |
| 基金拆分/份额折算前 | - | - |
| 基金拆分/份额折算调整 | - | - |
| 本期申购 | - | - |
| 本期赎回（以“-”号填列） | - | - |
| 本期末 | 194,670,738.88 | 194,670,738.88 |

华宝量化对冲混合 C

| 项目 | 本期 2022年1月1日至2022年6月30日 | |
|---------------|----------------------------|-----------------|
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 上年度末 | 466,002,488.72 | 466,002,488.72 |
| 本期申购 | 6,712,440.55 | 6,712,440.55 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -185,714,128.25 | -185,714,128.25 |
| 基金拆分/份额折算前 | - | - |
| 基金拆分/份额折算调整 | - | - |
| 本期申购 | - | - |
| 本期赎回（以“-”号填列） | - | - |
| 本期末 | 287,000,801.02 | 287,000,801.02 |

注：申购含红利再投以及转换入份（金）额，赎回含转换出份（金）额。

6.4.7.8 其他综合收益

6.4.7.9 未分配利润

单位：人民币元

华宝量化对冲混合 A

| 项目 | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
|----------------|----------------|----------------|----------------|
| 本期期初 | 90,714,860.43 | -27,710,622.23 | 63,004,238.20 |
| 本期利润 | 537,777.47 | -5,966,474.21 | -5,428,696.74 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -41,580,846.65 | 13,503,455.56 | -28,077,391.09 |
| 其中：基金申购款 | 443,762.78 | -135,941.36 | 307,821.42 |
| 基金赎回款 | -42,024,609.43 | 13,639,396.92 | -28,385,212.51 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | 49,671,791.25 | -20,173,640.88 | 29,498,150.37 |

华宝量化对冲混合 C

| 项目 | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
|----------------|----------------|----------------|----------------|
| 本期期初 | 103,358,424.39 | -34,651,945.06 | 68,706,479.33 |
| 本期利润 | -203,163.12 | -7,996,527.36 | -8,199,690.48 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -37,042,590.60 | 13,140,573.23 | -23,902,017.37 |
| 其中：基金申购款 | 1,467,738.53 | -557,843.22 | 909,895.31 |
| 基金赎回款 | -38,510,329.13 | 13,698,416.45 | -24,811,912.68 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | 66,112,670.67 | -29,507,899.19 | 36,604,771.48 |

6.4.7.10 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2022年1月1日至2022年6月30日 |
|-----------|----------------------------|
| 活期存款利息收入 | 26,433.00 |
| 定期存款利息收入 | - |
| 其他存款利息收入 | - |
| 结算备付金利息收入 | 883,876.52 |
| 其他 | 2,505.17 |
| 合计 | 912,814.69 |

6.4.7.11 股票投资收益

6.4.7.11.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2022年1月1日至2022年6月30日 |
|------------|----------------------------|
| 卖出股票成交总额 | 1,598,316,199.60 |
| 减：卖出股票成本总额 | 1,670,939,010.86 |
| 减：交易费用 | 4,603,341.16 |
| 买卖股票差价收入 | -77,226,152.42 |

6.4.7.12 债券投资收益

6.4.7.12.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2022年1月1日至2022年6月30日 |
|------------------------------|----------------------------|
| 债券投资收益——利息收入 | 641,412.25 |
| 债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入 | 111,676.51 |
| 债券投资收益——赎回差价收入 | - |
| 债券投资收益——申购差价收入 | - |
| 合计 | 753,088.76 |

6.4.7.12.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2022年1月1日至2022年6月30日 |
|------------------------|----------------------------|
| 卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额 | 69,091,665.10 |
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额 | 67,503,400.00 |
| 减：应计利息总额 | 1,476,325.35 |
| 减：交易费用 | 263.24 |
| 买卖债券差价收入 | 111,676.51 |

6.4.7.13 资产支持证券投资收益

6.4.7.13.1 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益

6.4.7.14.1 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益

6.4.7.15.1 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期收益金额 2022年1月1日至2022年6月30日 |
|----------|--------------------------------|
| 股指期货投资收益 | 75,098,514.83 |

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2022年1月1日至2022年6月30日 |
|---------------|----------------------------|
| 股票投资产生的股利收益 | 5,638,237.02 |
| 其中：证券出借权益补偿收入 | - |
| 基金投资产生的股利收益 | - |
| 合计 | 5,638,237.02 |

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称 | 本期 2022年1月1日至2022年6月30日 |
|------------|----------------------------|
| 1. 交易性金融资产 | 5,653,675.39 |
| 股票投资 | 5,525,635.39 |
| 债券投资 | 128,040.00 |

| | |
|------------------------|----------------|
| 资产支持证券投资 | - |
| 基金投资 | - |
| 贵金属投资 | - |
| 其他 | - |
| 2. 衍生工具 | -19,616,676.96 |
| 权证投资 | - |
| 期货投资 | -19,616,676.96 |
| 3. 其他 | - |
| 减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税 | - |
| 合计 | -13,963,001.57 |

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2022年1月1日至2022年6月30日 |
|---------|----------------------------|
| 基金赎回费收入 | 309,139.29 |
| 基金转换费收入 | 779.58 |
| 合计 | 309,918.87 |

注：1. 本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的 50%归入基金资产。

2. 本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中不低于转出基金的赎回费的 50%归入转出基金的基金资产。

6.4.7.19 信用减值损失

本基金本报告期内无信用减值损失。

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2022年1月1日至2022年6月30日 |
|----------------|----------------------------|
| 审计费用 | 29,752.78 |
| 信息披露费 | 59,507.37 |
| 证券出借违约金 | - |
| 银行费用 | 12,255.21 |
| 账户维护费 | 18,000.00 |
| 上清所 CFCA 证书服务费 | 600.00 |
| 合计 | 120,115.36 |

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无需要披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准报出日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

2022 年 4 月 25 日，中国证监会核准华平资产管理有限合伙（Warburg Pincus Asset Management, L.P.）将持有的华宝基金管理有限公司 20%股权转让给江苏省铁路集团。2022 年 5 月 24 日股权变更完成之后，华宝基金管理有限公司控股股东仍为华宝信托（持股 51%），华平投资（29%）、江苏省铁路集团（20%）分列第二、第三大股东。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

| 关联方名称 | 与本基金的关系 |
|---|-----------------------|
| 华宝基金管理有限公司（“华宝基金”） | 基金管理人, 注册登记机构, 基金销售机构 |
| 中国银行股份有限公司（“中国银行”） | 基金托管人, 基金销售机构 |
| 华宝信托有限责任公司（“华宝信托”） | 基金管理人的股东 |
| 华平资产管理有限合伙（Warburg Pincus Asset Management, L.P.） | 基金管理人的股东 |
| 中国宝武钢铁集团有限公司（“宝武集团”） | 华宝信托的最终控制人 |
| 华宝证券股份有限公司（“华宝证券”） | 受宝武集团控制的公司, 基金销售机构 |
| 华宝投资有限公司（“华宝投资”） | 受宝武集团控制的公司 |
| 江苏省铁路集团有限公司（“江苏铁集”） | 基金管理人的股东 |
| 宝武集团财务有限责任公司（“宝武财务”） | 受宝武集团控制的公司 |

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 | | 上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 | |
|-------|---------------------------------------|-------------------------|--|-------------------------|
| | 成交金额 | 占当期股票 成交总额的比例 (%) | 成交金额 | 占当期股票 成交总额的比例 (%) |
| 华宝证券 | - | - | 75,125,109.13 | 1.11 |

6.4.10.1.2 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 |
|-------|---------------------------------------|
| | |

| | 当期佣金 | 占当期佣金总量的比例 (%) | 期末应付佣金余额 | 占期末应付佣金总额的比例 (%) |
|-------|---------------------------------|----------------|-----------|------------------|
| | - | - | - | - |
| 关联方名称 | 上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日 | | | |
| | 当期佣金 | 占当期佣金总量的比例 (%) | 期末应付佣金余额 | 占期末应付佣金总额的比例 (%) |
| 华宝证券 | 68,461.68 | 1.10 | 68,461.68 | 1.04 |

注：1. 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

2. 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2022年1月1日至2022年6月30日 | 上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日 |
|-----------------|----------------------------|---------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 3,631,525.30 | 14,152,456.94 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 1,201,216.32 | 2,343,087.42 |

注：支付基金管理人华宝基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.00%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 1.00% / 当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2022年1月1日至2022年6月30日 | 上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日 |
|----------------|----------------------------|---------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 726,305.13 | 2,830,491.33 |

注：支付基金托管人中国银行股份有限公司的托管费按前一日基金资产净值 0.20%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.20% / 当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

| 获得销售服务费的各关 | 本期 2022年1月1日至2022年6月30日 |
|------------|----------------------------|
| | |

| 关联方名称 | 当期发生的基金应支付的销售服务费 | | |
|----------------|---------------------------------|------------|------------|
| | 华宝量化对冲混合 A | 华宝量化对冲混合 C | 合计 |
| 华宝基金 | | 21,735.31 | 21,735.31 |
| 华宝证券 | | 0.31 | 0.31 |
| 中国银行 | | 440,005.81 | 440,005.81 |
| 合计 | | 461,741.43 | 461,741.43 |
| 获得销售服务费的各关联方名称 | 上年度可比期间 | | |
| | 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 | | |
| | 当期发生的基金应支付的销售服务费 | | |
| | 华宝量化对冲混合 A | 华宝量化对冲混合 C | 合计 |
| 中国银行 | | 216,793.32 | 216,793.32 |
| 华宝证券 | | 129.63 | 129.63 |
| 华宝基金 | | 36,642.82 | 36,642.82 |
| 合计 | | 253,565.77 | 253,565.77 |

注：销售服务费每日计提，按月支付。A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值的 0.40% 年费率计提。本基金 C 类基金份额销售服务费计提的计算方法如下： $H = E \times 0.40\% \div \text{当年天数}$ ，H 为 C 类基金份额每日应计提的基金销售服务费 E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间无转融通证券出借业务。

6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

份额单位：份

| 项目 | 本期 | 本期 |
|----|---------------------------------|---------------------------------|
| | 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 | 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 |
| | 华宝量化对冲混合 A | 华宝量化对冲混合 C |

| | | |
|---------------------------------|--|--|
| 基金合同生效日（2014 年 9 月 17 日）持有的基金份额 | - | - |
| 报告期初持有的基金份额 | - | - |
| 报告期内申购/买入总份额 | - | - |
| 报告期内因拆分变动份额 | - | - |
| 减：报告期内赎回/卖出总份额 | - | - |
| 报告期末持有的基金份额 | - | - |
| 报告期末持有的基金份额占基金总份额比例 | - | - |
| 项目 | 上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 |
| | 华宝量化对冲混合 A | 华宝量化对冲混合 C |
| 基金合同生效日（2014 年 9 月 17 日）持有的基金份额 | - | - |
| 报告期初持有的基金份额 | 21,989,995.33 | 2,947,386.26 |
| 报告期内申购/买入总份额 | - | - |
| 报告期内因拆分变动份额 | - | - |
| 减：报告期内赎回/卖出总份额 | - | - |
| 报告期末持有的基金份额 | 21,989,995.33 | 2,947,386.26 |
| 报告期末持有的基金份额占基金总份额比例 | 1.91% | 0.63% |

注：基金管理人投资本基金适用的认(申)购/赎回费率按照本基金招募说明书的规定执行。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：本报告期末及上年度末除基金管理人外其他关联方未投资本基金。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 | | 上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 | |
|------------|---------------------------------------|-----------|--|------------|
| | 期末余额 | 当期利息收入 | 期末余额 | 当期利息收入 |
| 中国银行股份有限公司 | 2,023,822.61 | 26,433.00 | 163,449,782.48 | 139,302.83 |

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行股份有限公司保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末(2022年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

| 6.4.12.1.1 受限证券类别：股票 | | | | | | | | | | |
|----------------------|------|------------|-----|--------|-------|--------|--------------|-----------|-----------|----------|
| 证券代码 | 证券名称 | 成功认购日 | 受限期 | 流通受限类型 | 认购价格 | 期末估值单价 | 数量 (单位：股) | 期末成本总额 | 期末估值总额 | 备注 |
| 300834 | 星辉环材 | 2022年1月6日 | 6个月 | 新股锁定 | 55.57 | 30.03 | 635 | 35,286.95 | 19,069.05 | - |
| 301097 | 天益医疗 | 2022年3月25日 | 6个月 | 新股锁定 | 52.37 | 47.83 | 249 | 13,040.13 | 11,909.67 | - |
| 301103 | 何氏眼科 | 2022年3月14日 | 6个月 | 新股锁定 | 42.50 | 32.02 | 507 | 16,575.00 | 16,234.14 | 含转增股117股 |
| 301109 | 军信股份 | 2022年4月6日 | 6个月 | 新股锁定 | 34.81 | 16.14 | 1,388 | 32,199.25 | 22,402.32 | 含转增股463股 |
| 301122 | 采纳股份 | 2022年1月19日 | 6个月 | 新股锁定 | 50.31 | 70.37 | 301 | 15,143.31 | 21,181.37 | - |
| 301123 | 奕东电子 | 2022年1月14日 | 6个月 | 新股锁定 | 37.23 | 25.39 | 656 | 24,422.88 | 16,655.84 | - |
| 301181 | 标榜股份 | 2022年2月11日 | 6个月 | 新股锁定 | 40.25 | 30.59 | 257 | 10,344.25 | 7,861.63 | - |
| 301196 | 唯科科技 | 2022年1月4日 | 6个月 | 新股锁定 | 64.08 | 37.52 | 271 | 17,365.68 | 10,167.92 | - |
| 301201 | 诚达 | 2022年 | 6个月 | 新股锁 | 72.69 | 71.54 | 353 | 25,659.57 | 25,253.62 | - |

| | | | | | | | | | | | |
|--------|------|------------|-----|------|--------|-------|--------|------------|------------|----------|--|
| | 药业 | 1月12日 | | 定 | | | | | | | |
| 301206 | 三元生物 | 2022年1月26日 | 6个月 | 新股锁定 | 109.30 | 45.69 | 641 | 46,671.10 | 29,287.29 | 含转增股214股 | |
| 301207 | 华兰疫苗 | 2022年2月10日 | 6个月 | 新股锁定 | 56.88 | 56.42 | 402 | 22,865.76 | 22,680.84 | - | |
| 301212 | 联盛化学 | 2022年4月7日 | 6个月 | 新股锁定 | 29.67 | 33.28 | 416 | 12,342.72 | 13,844.48 | - | |
| 301219 | 腾远钴业 | 2022年3月10日 | 6个月 | 新股锁定 | 173.98 | 87.82 | 223 | 21,573.52 | 19,583.86 | 含转增股99股 | |
| 301228 | 实朴检测 | 2022年1月21日 | 6个月 | 新股锁定 | 20.08 | 20.34 | 373 | 7,489.84 | 7,586.82 | - | |
| 301236 | 软通动力 | 2022年3月8日 | 6个月 | 新股锁定 | 72.88 | 31.38 | 945 | 45,914.40 | 29,654.10 | 含转增股315股 | |
| 301259 | 艾布鲁 | 2022年4月18日 | 6个月 | 新股锁定 | 18.39 | 24.94 | 483 | 8,882.37 | 12,046.02 | - | |
| 301263 | 泰恩康 | 2022年3月22日 | 6个月 | 新股锁定 | 19.93 | 31.38 | 682 | 13,592.26 | 21,401.16 | - | |
| 301279 | 金道科技 | 2022年4月6日 | 6个月 | 新股锁定 | 31.20 | 22.81 | 296 | 9,235.20 | 6,751.76 | - | |
| 688150 | 莱特光电 | 2022年3月10日 | 6个月 | 新股锁定 | 22.05 | 19.60 | 5,626 | 124,053.30 | 110,269.60 | - | |
| 688153 | 唯捷创芯 | 2022年4月1日 | 6个月 | 新股锁定 | 66.60 | 44.24 | 5,135 | 341,991.00 | 227,172.40 | - | |
| 688213 | 思特威 | 2022年5月13日 | 6个月 | 新股锁定 | 31.51 | 49.01 | 14,046 | 442,589.46 | 688,394.46 | - | |
| 688238 | 和元生物 | 2022年3月15日 | 6个月 | 新股锁定 | 13.23 | 25.32 | 12,836 | 169,820.28 | 325,007.52 | - | |
| 688283 | 坤恒顺维 | 2022年2月8日 | 6个月 | 新股锁定 | 33.80 | 45.41 | 1,595 | 53,911.00 | 72,428.95 | - | |

| 688322 | 奥比中光 | 2022年6月30日 | 1个月内 | 新股流通受限 | 30.99 | 30.99 | 8,529 | 264,313.71 | 264,313.71 | - |
|----------------------|---------|------------|---------|--------|--------|--------|----------|------------|------------|----|
| 6.4.12.1.2 受限证券类别：债券 | | | | | | | | | | |
| 证券代码 | 证券名称 | 成功认购日 | 受限期 | 流通受限类型 | 认购价格 | 期末估值单价 | 数量（单位：张） | 期末成本总额 | 期末估值总额 | 备注 |
| 113060 | 浙 22 转债 | 2022年6月14日 | 1个月内（含） | 新债流通受限 | 100.00 | 100.01 | 4,030 | 403,000.00 | 403,030.03 | - |

注：1. 根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行业倡导建议》，本基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期为自发行人股票上市之日起 6 个月。根据《上海证券交易所科创板上市公司股东以向特定机构投资者询价转让和配售方式减持股份实施细则》，基金通过询价转让受让的股份，在受让后 6 个月内不得转让。

2. 根据《深圳证券交易所创业板首次公开发行证券发行与承销业务实施细则》，发行人和主承销商可以采用摇号限售方式或比例限售方式，安排基金通过网下发行获配的部分创业板股票设置不低于 6 个月的限售期。

3. 基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金参与网下申购获得的新股或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无银行间市场债券正回购，因此没有在银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购，因此没有在交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为特殊类型的混合型基金，主要采用追求绝对收益的市场中性策略，与股票市场表现的相关性较低。相对股票型基金和一般的混合型基金，其预期风险较小。本基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资、股指期货等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，公司内部监督和反馈系统包括内部控制委员会、督察长、合规审计部、风险管理部、各部门负责人和风险控制联络人、各业务岗位。内部控制委员会负责对公司在经营管理和基金运作中的风险进行评估并研究制订相应的控制制度。督察长向董事会负责，总管公司的内控事务并独立地就内控制度的执行情况履行检查、评价、报告和建议职能。风险管理部在督察长指导下对公司内部控制运行情况进行监控，主要针对公司内部控制制度的总体构架和内部控制的目标进行评估并提出改进意见；合规审计部在督察长的领导下对各部门和岗位的内部控制执行情况进行监督和核查，同时对内控的失控点进行查漏并责令改正。

本基金的基金管理人根据自身经营特点设立顺序递进、权责统一、严密有效的四层监控防线。第一层监控防线为一线岗位自控与互控；第二层防线为大业务板块内部各部门和部门之间的自控和互控；第三层监控防线为风险管理部和合规审计部对各岗位、各部门、各项业务全面实施的监督反馈；最后是以内部控制委员会为主体的第四层防线，实施对公司各类业务和风险的总体监督、控制，并对风险管理部和合规审计部的工作予以直接指导。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法是通过结合定性分析和定量分析方法，估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具的特征，通过特定的风险量化指标、模型、日常的量化报告，确定相应置信程度和风险损失的限度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款

存放在本基金的托管行中国银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

于本报告期末，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券和资产支持证券占基金资产净值的比例较低（含债券投资比例为零），因此无重大信用风险（上年度末：同）。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

于本报告期末，除附注中列示的卖出回购金融资产款将在一个月以内到期且计息（该利息金额不重大）外，本基金所承担的其他金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值（所有者权益）无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家上市公司发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%（完全按照有关指数构成比例进行证

券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

本报告期内，基金管理人坚持组合管理、分散投资的基本原则，严格按照法律法规的有关规定和基金合同约定的投资范围与比例限制实施投资管理。本基金所持大部分证券在证券交易所上市或银行间同业市场交易，不存在具有重大流动性风险的投资品种。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金、债券投资及买入返售金融资产等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末 2022年6月30日 | 1年以内 | 1-5年 | 5年以上 | 不计息 | 合计 |
|---------------------|----------------|------|------------|----------------|------------------|
| 资产 | | | | | |
| 银行存款 | 2,023,822.61 | - | - | - | 2,023,822.61 |
| 结算备付金 | 32,196,367.99 | - | - | - | 32,196,367.99 |
| 存出保证金 | 259,319.69 | - | - | 47,609,334.40 | 47,868,654.09 |
| 交易性金融资产 | 35,636,102.74 | - | 403,030.03 | 430,153,046.75 | 466,192,179.52 |
| 买入返售金融资产 | 11,615,000.00 | - | - | - | 11,615,000.00 |
| 应收申购款 | - | - | - | 49,884.53 | 49,884.53 |
| 应收清算款 | - | - | - | 9,691,743.12 | 9,691,743.12 |
| 资产总计 | 81,730,613.03 | - | 403,030.03 | 487,504,008.80 | 569,637,651.86 |
| 负债 | | | | | |
| 应付赎回款 | - | - | - | 13,492,540.46 | 13,492,540.46 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 492,998.81 | 492,998.81 |
| 应付托管费 | - | - | - | 98,599.80 | 98,599.80 |
| 应付清算款 | - | - | - | 3,161,081.84 | 3,161,081.84 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | 121,021.82 | 121,021.82 |
| 应交税费 | - | - | - | 808,202.09 | 808,202.09 |
| 其他负债 | - | - | - | 3,688,745.29 | 3,688,745.29 |
| 负债总计 | - | - | - | 21,863,190.11 | 21,863,190.11 |
| 利率敏感度缺口 | 81,730,613.03 | - | 403,030.03 | 465,640,818.69 | 547,774,461.75 |
| 上年度末 2021年12月31日 | 1年以内 | 1-5年 | 5年以上 | 不计息 | 合计 |
| 资产 | | | | | |
| 银行存款 | 2,977,532.20 | - | - | - | 2,977,532.20 |
| 结算备付金 | 75,255,486.34 | - | - | - | 75,255,486.34 |
| 存出保证金 | 595,171.94 | - | - | 86,570,625.60 | 87,165,797.54 |
| 交易性金融资产 | 55,575,050.00 | - | 880,000.00 | 735,906,545.35 | 792,361,595.35 |
| 买入返售金融资产 | 22,000,000.00 | - | - | - | 22,000,000.00 |
| 应收申购款 | - | - | - | 87,059.98 | 87,059.98 |
| 应收证券清算款 | - | - | - | 36,239,970.53 | 36,239,970.53 |
| 其他资产 | - | - | - | 1,207,847.31 | 1,207,847.31 |
| 资产总计 | 156,403,240.48 | - | 880,000.00 | 860,012,048.77 | 1,017,295,289.25 |
| 负债 | | | | | |
| 应付赎回款 | - | - | - | 38,729,282.51 | 38,729,282.51 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 1,042,745.77 | 1,042,745.77 |
| 应付托管费 | - | - | - | 208,549.15 | 208,549.15 |
| 应付证券清算款 | - | - | - | 4,467,487.41 | 4,467,487.41 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | 191,204.82 | 191,204.82 |
| 应交税费 | - | - | - | 27.46 | 27.46 |
| 其他负债 | - | - | - | 3,270,027.66 | 3,270,027.66 |
| 负债总计 | - | - | - | 47,909,324.78 | 47,909,324.78 |

| | | | | | |
|---------|----------------|---|------------|----------------|----------------|
| 利率敏感度缺口 | 156,403,240.48 | - | 880,000.00 | 812,102,723.99 | 969,385,964.47 |
|---------|----------------|---|------------|----------------|----------------|

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于本报告期末，本基金未持有交易性债券投资或持有比例较低，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(上年度末：同)。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，基金管理人主要运用股指期货等空头工具对持有的股票等权益类多头组合进行对冲操作，规避权益类多头组合的市场系统性风险；同时预留必要的现金，以应对保证金的增加要求或投资者的赎回申请。在股票投资方面，主要采用量化行业配置模型和量化 Alpha 选股模型构建指数增强股票组合，严格控制运作风险，并根据市场变化趋势，定期对模型进行调整，以改进模型的有效性，最大化超额收益。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金的投资组合比例为：本基金权益类空头头寸的价值占本基金权益类多头头寸的价值的比例范围在 80%-120%之间。每个交易日日终，持有的买入期货合约价值和有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 95%。在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2022 年 6 月 30 日 | 上年度末 2021 年 12 月 31 日 |
|----|------------------------|--------------------------|
|----|------------------------|--------------------------|

| | 公允价值 | 占基金资产净值比例 (%) | 公允价值 | 占基金资产净值比例 (%) |
|---------------|----------------|---------------|----------------|---------------|
| 交易性金融资产—股票投资 | 430,153,046.75 | 78.53 | 735,906,545.35 | 75.91 |
| 交易性金融资产—基金投资 | - | - | - | - |
| 交易性金融资产—贵金属投资 | - | - | - | - |
| 衍生金融资产—权证投资 | - | - | - | - |
| 其他 | - | - | - | - |
| 合计 | 430,153,046.75 | 78.53 | 735,906,545.35 | 75.91 |

注：其他包含在期货交易所交易的期货投资。在当日无负债结算制度下，期货投资与相关的期货暂收款(结算所得的持仓损益)之间按抵销后的净额为 0。

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

| 假设 | 除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变- | | |
|-----------|-----------------------------|-------------------|---------------|
| 相关风险变量的变动 | 对资产负债表日基金资产净值的影响金额(单位:人民币元) | | |
| | 本期末(2022年6月30日) | 上年度末(2021年12月31日) | |
| 分析 | 1. 业绩比较基准上升 5% | 2,214,064.27 | 5,039,776.77 |
| | 2. 业绩比较基准下降 5% | -2,214,064.27 | -5,039,776.77 |

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次,由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定:第一层次:相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价;第二层次:除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值;第三层次:相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位:人民币元

| 公允价值计量结果所属的层次 | 本期末 2022 年 6 月 30 日 | 上年度末 2021 年 12 月 31 日 |
|---------------|------------------------|--------------------------|
| 第一层次 | 428,151,888.22 | 732,331,459.08 |
| 第二层次 | 36,303,446.48 | 56,460,554.49 |
| 第三层次 | 1,736,844.82 | 3,569,581.78 |
| 合计 | 466,192,179.52 | 792,361,595.35 |

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票、债券和基金的公允价值应属第二层次还是第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于本报告期末，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(上年度末：同)。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目 | 金额 | 占基金总资产的比例 (%) |
|----|--------|----------------|------------------|
| 1 | 权益投资 | 430,153,046.75 | 75.51 |
| | 其中：股票 | 430,153,046.75 | 75.51 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 36,039,132.77 | 6.33 |
| | 其中：债券 | 36,039,132.77 | 6.33 |
| | 资产支持证券 | - | - |

| | | | |
|---|-------------------|----------------|--------|
| 4 | 贵金属投资 | - | - |
| 5 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 6 | 买入返售金融资产 | 11,615,000.00 | 2.04 |
| | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | - | - |
| 7 | 银行存款和结算备付金合计 | 34,220,190.60 | 6.01 |
| 8 | 其他各项资产 | 57,610,281.74 | 10.11 |
| 9 | 合计 | 569,637,651.86 | 100.00 |

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

| 代码 | 行业类别 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|------------------|----------------|--------------|
| A | 农、林、牧、渔业 | 2,263,540.00 | 0.41 |
| B | 采矿业 | 16,036,329.00 | 2.93 |
| C | 制造业 | 256,310,136.72 | 46.79 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 12,663,126.00 | 2.31 |
| E | 建筑业 | 10,335,529.60 | 1.89 |
| F | 批发和零售业 | 5,714,044.96 | 1.04 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 8,899,612.00 | 1.62 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 14,364,117.24 | 2.62 |
| J | 金融业 | 75,170,984.90 | 13.72 |
| K | 房地产业 | 13,634,212.62 | 2.49 |
| L | 租赁和商务服务业 | 2,257,451.00 | 0.41 |
| M | 科学研究和技术服务业 | 6,425,600.23 | 1.17 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 910,488.34 | 0.17 |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | 4,373,334.14 | 0.80 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | 633,619.00 | 0.12 |
| S | 综合 | 160,921.00 | 0.03 |
| | 合计 | 430,153,046.75 | 78.53 |

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量（股） | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|------|------|-------|---------|--------------|
|----|------|------|-------|---------|--------------|

| | | | | | |
|----|--------|--------|-----------|---------------|------|
| 1 | 600519 | 贵州茅台 | 9,504 | 19,435,680.00 | 3.55 |
| 2 | 601318 | 中国平安 | 269,300 | 12,573,617.00 | 2.30 |
| 3 | 601166 | 兴业银行 | 542,283 | 10,791,431.70 | 1.97 |
| 4 | 000568 | 泸州老窖 | 34,500 | 8,505,630.00 | 1.55 |
| 5 | 300750 | 宁德时代 | 14,400 | 7,689,600.00 | 1.40 |
| 6 | 002304 | 洋河股份 | 39,100 | 7,161,165.00 | 1.31 |
| 7 | 601668 | 中国建筑 | 1,282,480 | 6,822,793.60 | 1.25 |
| 8 | 601857 | 中国石油 | 1,184,000 | 6,275,200.00 | 1.15 |
| 9 | 000002 | 万科 A | 293,700 | 6,020,850.00 | 1.10 |
| 10 | 600438 | 通威股份 | 94,200 | 5,638,812.00 | 1.03 |
| 11 | 002129 | TCL 中环 | 95,100 | 5,600,439.00 | 1.02 |
| 12 | 000858 | 五粮液 | 26,800 | 5,411,724.00 | 0.99 |
| 13 | 601688 | 华泰证券 | 360,200 | 5,114,840.00 | 0.93 |
| 14 | 600030 | 中信证券 | 214,055 | 4,636,431.30 | 0.85 |
| 15 | 600036 | 招商银行 | 106,900 | 4,511,180.00 | 0.82 |
| 16 | 601009 | 南京银行 | 398,800 | 4,155,496.00 | 0.76 |
| 17 | 600887 | 伊利股份 | 105,500 | 4,109,225.00 | 0.75 |
| 18 | 002821 | 凯莱英 | 14,200 | 4,103,800.00 | 0.75 |
| 19 | 002555 | 三七互娱 | 193,300 | 4,103,759.00 | 0.75 |
| 20 | 002142 | 宁波银行 | 112,350 | 4,023,253.50 | 0.73 |
| 21 | 601919 | 中远海控 | 283,200 | 3,936,480.00 | 0.72 |
| 22 | 600426 | 华鲁恒升 | 131,600 | 3,842,720.00 | 0.70 |
| 23 | 600809 | 山西汾酒 | 11,800 | 3,832,640.00 | 0.70 |
| 24 | 601319 | 中国人保 | 756,000 | 3,825,360.00 | 0.70 |
| 25 | 603882 | 金域医学 | 46,000 | 3,797,300.00 | 0.69 |
| 26 | 000333 | 美的集团 | 61,698 | 3,725,942.22 | 0.68 |
| 27 | 600919 | 江苏银行 | 519,400 | 3,698,128.00 | 0.68 |
| 28 | 002459 | 晶澳科技 | 46,560 | 3,673,584.00 | 0.67 |
| 29 | 601398 | 工商银行 | 735,000 | 3,505,950.00 | 0.64 |
| 30 | 002466 | 天齐锂业 | 27,400 | 3,419,520.00 | 0.62 |
| 31 | 002460 | 赣锋锂业 | 22,800 | 3,390,360.00 | 0.62 |
| 32 | 600886 | 国投电力 | 319,600 | 3,355,800.00 | 0.61 |
| 33 | 600383 | 金地集团 | 246,100 | 3,307,584.00 | 0.60 |
| 34 | 600584 | 长电科技 | 117,501 | 3,172,527.00 | 0.58 |
| 35 | 601328 | 交通银行 | 609,100 | 3,033,318.00 | 0.55 |
| 36 | 002709 | 天赐材料 | 48,800 | 3,028,528.00 | 0.55 |
| 37 | 601985 | 中国核电 | 436,500 | 2,994,390.00 | 0.55 |
| 38 | 601012 | 隆基绿能 | 44,693 | 2,977,894.59 | 0.54 |
| 39 | 300450 | 先导智能 | 46,100 | 2,912,598.00 | 0.53 |
| 40 | 688012 | 中微公司 | 24,726 | 2,886,760.50 | 0.53 |
| 41 | 000625 | 长安汽车 | 164,400 | 2,847,408.00 | 0.52 |
| 42 | 002410 | 广联达 | 52,100 | 2,836,324.00 | 0.52 |

| | | | | | |
|----|--------|--------|---------|--------------|------|
| 43 | 603392 | 万泰生物 | 18,145 | 2,817,918.50 | 0.51 |
| 44 | 603259 | 药明康德 | 26,111 | 2,715,282.89 | 0.50 |
| 45 | 300059 | 东方财富 | 105,574 | 2,681,579.60 | 0.49 |
| 46 | 601615 | 明阳智能 | 75,500 | 2,551,900.00 | 0.47 |
| 47 | 002202 | 金风科技 | 170,000 | 2,516,000.00 | 0.46 |
| 48 | 600900 | 长江电力 | 107,400 | 2,483,088.00 | 0.45 |
| 49 | 600089 | 特变电工 | 82,200 | 2,251,458.00 | 0.41 |
| 50 | 601225 | 陕西煤业 | 106,100 | 2,247,198.00 | 0.41 |
| 51 | 600141 | 兴发集团 | 50,600 | 2,225,894.00 | 0.41 |
| 52 | 002271 | 东方雨虹 | 42,600 | 2,192,622.00 | 0.40 |
| 53 | 600176 | 中国巨石 | 124,600 | 2,169,286.00 | 0.40 |
| 54 | 000661 | 长春高新 | 9,200 | 2,147,464.00 | 0.39 |
| 55 | 601211 | 国泰君安 | 140,800 | 2,140,160.00 | 0.39 |
| 56 | 600325 | 华发股份 | 277,200 | 2,098,404.00 | 0.38 |
| 57 | 600276 | 恒瑞医药 | 55,100 | 2,043,659.00 | 0.37 |
| 58 | 600741 | 华域汽车 | 88,300 | 2,030,900.00 | 0.37 |
| 59 | 300037 | 新宙邦 | 38,220 | 2,008,843.20 | 0.37 |
| 60 | 000596 | 古井贡酒 | 8,000 | 1,997,280.00 | 0.36 |
| 61 | 688005 | 容百科技 | 15,307 | 1,981,338.08 | 0.36 |
| 62 | 002049 | 紫光国微 | 10,400 | 1,973,088.00 | 0.36 |
| 63 | 002415 | 海康威视 | 54,000 | 1,954,800.00 | 0.36 |
| 64 | 300896 | 爱美客 | 3,200 | 1,920,032.00 | 0.35 |
| 65 | 000100 | TCL 科技 | 400,800 | 1,919,832.00 | 0.35 |
| 66 | 601888 | 中国中免 | 7,900 | 1,840,147.00 | 0.34 |
| 67 | 601989 | 中国重工 | 495,800 | 1,839,418.00 | 0.34 |
| 68 | 603659 | 璞泰来 | 21,400 | 1,806,160.00 | 0.33 |
| 69 | 601800 | 中国交建 | 194,400 | 1,804,032.00 | 0.33 |
| 70 | 601066 | 中信建投 | 62,400 | 1,803,984.00 | 0.33 |
| 71 | 300316 | 晶盛机电 | 26,600 | 1,797,894.00 | 0.33 |
| 72 | 601838 | 成都银行 | 108,300 | 1,795,614.00 | 0.33 |
| 73 | 600570 | 恒生电子 | 40,800 | 1,776,432.00 | 0.32 |
| 74 | 002714 | 牧原股份 | 32,000 | 1,768,640.00 | 0.32 |
| 75 | 000977 | 浪潮信息 | 66,700 | 1,766,216.00 | 0.32 |
| 76 | 300308 | 中际旭创 | 56,100 | 1,741,905.00 | 0.32 |
| 77 | 300347 | 泰格医药 | 15,100 | 1,728,195.00 | 0.32 |
| 78 | 002738 | 中矿资源 | 18,560 | 1,718,841.60 | 0.31 |
| 79 | 600219 | 南山铝业 | 464,000 | 1,712,160.00 | 0.31 |
| 80 | 300979 | 华利集团 | 23,200 | 1,695,456.00 | 0.31 |
| 81 | 600153 | 建发股份 | 129,600 | 1,693,872.00 | 0.31 |
| 82 | 601658 | 邮储银行 | 313,500 | 1,689,765.00 | 0.31 |
| 83 | 000651 | 格力电器 | 49,600 | 1,672,512.00 | 0.31 |
| 84 | 603986 | 兆易创新 | 11,748 | 1,670,683.08 | 0.30 |

| | | | | | |
|-----|--------|-------|---------|--------------|------|
| 85 | 600150 | 中国船舶 | 87,200 | 1,655,056.00 | 0.30 |
| 86 | 300775 | 三角防务 | 34,200 | 1,646,730.00 | 0.30 |
| 87 | 000733 | 振华科技 | 12,100 | 1,645,237.00 | 0.30 |
| 88 | 000425 | 徐工机械 | 304,000 | 1,638,560.00 | 0.30 |
| 89 | 002236 | 大华股份 | 99,400 | 1,632,148.00 | 0.30 |
| 90 | 002332 | 仙琚制药 | 165,368 | 1,623,913.76 | 0.30 |
| 91 | 601006 | 大秦铁路 | 240,000 | 1,581,600.00 | 0.29 |
| 92 | 605123 | 派克新材 | 11,000 | 1,547,920.00 | 0.28 |
| 93 | 601607 | 上海医药 | 84,600 | 1,529,568.00 | 0.28 |
| 94 | 002475 | 立讯精密 | 44,000 | 1,486,760.00 | 0.27 |
| 95 | 600048 | 保利发展 | 85,010 | 1,484,274.60 | 0.27 |
| 96 | 603816 | 顾家家居 | 25,530 | 1,445,763.90 | 0.26 |
| 97 | 000001 | 平安银行 | 95,200 | 1,426,096.00 | 0.26 |
| 98 | 300363 | 博腾股份 | 18,100 | 1,411,619.00 | 0.26 |
| 99 | 600256 | 广汇能源 | 133,900 | 1,411,306.00 | 0.26 |
| 100 | 002353 | 杰瑞股份 | 35,000 | 1,410,500.00 | 0.26 |
| 101 | 000725 | 京东方 A | 356,800 | 1,405,792.00 | 0.26 |
| 102 | 600563 | 法拉电子 | 6,800 | 1,395,088.00 | 0.25 |
| 103 | 000708 | 中信特钢 | 69,200 | 1,394,380.00 | 0.25 |
| 104 | 300390 | 天华超净 | 15,800 | 1,380,920.00 | 0.25 |
| 105 | 300122 | 智飞生物 | 12,400 | 1,376,524.00 | 0.25 |
| 106 | 600380 | 健康元 | 110,200 | 1,360,970.00 | 0.25 |
| 107 | 603019 | 中科曙光 | 46,200 | 1,340,724.00 | 0.24 |
| 108 | 002756 | 永兴材料 | 8,800 | 1,339,448.00 | 0.24 |
| 109 | 600027 | 华电国际 | 338,400 | 1,329,912.00 | 0.24 |
| 110 | 000792 | 盐湖股份 | 44,000 | 1,318,240.00 | 0.24 |
| 111 | 002594 | 比亚迪 | 3,940 | 1,313,950.60 | 0.24 |
| 112 | 300760 | 迈瑞医疗 | 4,100 | 1,284,120.00 | 0.23 |
| 113 | 601088 | 中国神华 | 38,400 | 1,278,720.00 | 0.23 |
| 114 | 600104 | 上汽集团 | 71,000 | 1,264,510.00 | 0.23 |
| 115 | 002120 | 韵达股份 | 71,200 | 1,214,672.00 | 0.22 |
| 116 | 601717 | 郑煤机 | 82,400 | 1,187,384.00 | 0.22 |
| 117 | 603185 | 上机数控 | 7,600 | 1,185,524.00 | 0.22 |
| 118 | 600585 | 海螺水泥 | 33,408 | 1,178,634.24 | 0.22 |
| 119 | 002352 | 顺丰控股 | 20,800 | 1,160,848.00 | 0.21 |
| 120 | 603589 | 口子窖 | 19,600 | 1,148,756.00 | 0.21 |
| 121 | 688396 | 华润微 | 19,000 | 1,122,330.00 | 0.20 |
| 122 | 600862 | 中航高科 | 39,600 | 1,112,760.00 | 0.20 |
| 123 | 600486 | 扬农化工 | 8,200 | 1,092,896.00 | 0.20 |
| 124 | 000063 | 中兴通讯 | 42,400 | 1,082,472.00 | 0.20 |
| 125 | 600050 | 中国联通 | 308,600 | 1,067,756.00 | 0.19 |
| 126 | 002946 | 新乳业 | 80,400 | 1,044,396.00 | 0.19 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|---------|--------------|------|
| 127 | 002262 | 恩华药业 | 75,800 | 1,030,880.00 | 0.19 |
| 128 | 002050 | 三花智控 | 36,800 | 1,011,264.00 | 0.18 |
| 129 | 300661 | 圣邦股份 | 5,500 | 1,001,110.00 | 0.18 |
| 130 | 601868 | 中国能建 | 417,600 | 989,712.00 | 0.18 |
| 131 | 002815 | 崇达技术 | 76,800 | 983,808.00 | 0.18 |
| 132 | 600795 | 国电电力 | 248,800 | 972,808.00 | 0.18 |
| 133 | 002230 | 科大讯飞 | 23,200 | 956,304.00 | 0.17 |
| 134 | 002920 | 德赛西威 | 6,400 | 947,200.00 | 0.17 |
| 135 | 688598 | 金博股份 | 3,200 | 943,040.00 | 0.17 |
| 136 | 601916 | 浙商银行 | 282,400 | 937,568.00 | 0.17 |
| 137 | 600755 | 厦门国贸 | 123,200 | 924,000.00 | 0.17 |
| 138 | 688363 | 华熙生物 | 6,400 | 909,952.00 | 0.17 |
| 139 | 002549 | 凯美特气 | 48,400 | 876,040.00 | 0.16 |
| 140 | 688008 | 澜起科技 | 14,327 | 867,929.66 | 0.16 |
| 141 | 300832 | 新产业 | 19,200 | 866,112.00 | 0.16 |
| 142 | 002508 | 老板电器 | 24,000 | 864,720.00 | 0.16 |
| 143 | 002867 | 周大生 | 55,600 | 863,468.00 | 0.16 |
| 144 | 600873 | 梅花生物 | 76,400 | 861,792.00 | 0.16 |
| 145 | 600031 | 三一重工 | 44,800 | 853,888.00 | 0.16 |
| 146 | 600309 | 万华化学 | 8,800 | 853,512.00 | 0.16 |
| 147 | 002064 | 华峰化学 | 100,800 | 850,752.00 | 0.16 |
| 148 | 603658 | 安图生物 | 17,400 | 850,686.00 | 0.16 |
| 149 | 002938 | 鹏鼎控股 | 28,000 | 845,880.00 | 0.15 |
| 150 | 601231 | 环旭电子 | 58,800 | 844,368.00 | 0.15 |
| 151 | 300759 | 康龙化成 | 8,800 | 837,936.00 | 0.15 |
| 152 | 601666 | 平煤股份 | 61,600 | 837,144.00 | 0.15 |
| 153 | 600332 | 白云山 | 26,400 | 833,976.00 | 0.15 |
| 154 | 300217 | 东方电热 | 136,000 | 832,320.00 | 0.15 |
| 155 | 603501 | 韦尔股份 | 4,800 | 830,544.00 | 0.15 |
| 156 | 002841 | 视源股份 | 11,000 | 828,520.00 | 0.15 |
| 157 | 000423 | 东阿阿胶 | 22,400 | 827,680.00 | 0.15 |
| 158 | 000933 | 神火股份 | 63,200 | 826,656.00 | 0.15 |
| 159 | 601899 | 紫金矿业 | 88,500 | 825,705.00 | 0.15 |
| 160 | 600760 | 中航沈飞 | 13,640 | 824,538.00 | 0.15 |
| 161 | 600028 | 中国石化 | 201,700 | 822,936.00 | 0.15 |
| 162 | 002007 | 华兰生物 | 36,000 | 820,800.00 | 0.15 |
| 163 | 600522 | 中天科技 | 35,200 | 813,120.00 | 0.15 |
| 164 | 002258 | 利尔化学 | 34,400 | 812,528.00 | 0.15 |
| 165 | 600737 | 中粮糖业 | 108,000 | 812,160.00 | 0.15 |
| 166 | 603232 | 格尔软件 | 70,354 | 809,774.54 | 0.15 |
| 167 | 002009 | 天奇股份 | 43,600 | 806,600.00 | 0.15 |
| 168 | 002241 | 歌尔股份 | 23,982 | 805,795.20 | 0.15 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|---------|------------|------|
| 169 | 600905 | 三峡能源 | 128,000 | 805,120.00 | 0.15 |
| 170 | 002759 | 天际股份 | 29,600 | 804,528.00 | 0.15 |
| 171 | 000975 | 银泰黄金 | 82,600 | 804,524.00 | 0.15 |
| 172 | 600660 | 福耀玻璃 | 19,200 | 802,752.00 | 0.15 |
| 173 | 002812 | 恩捷股份 | 3,200 | 801,440.00 | 0.15 |
| 174 | 002832 | 比音勒芬 | 29,524 | 744,004.80 | 0.14 |
| 175 | 603599 | 广信股份 | 26,320 | 740,908.00 | 0.14 |
| 176 | 002597 | 金禾实业 | 17,000 | 736,610.00 | 0.13 |
| 177 | 688213 | 思特威 | 14,046 | 688,394.46 | 0.13 |
| 178 | 002216 | 三全食品 | 33,400 | 654,306.00 | 0.12 |
| 179 | 300769 | 德方纳米 | 1,600 | 653,888.00 | 0.12 |
| 180 | 603337 | 杰克股份 | 30,000 | 644,400.00 | 0.12 |
| 181 | 300596 | 利安隆 | 14,600 | 644,006.00 | 0.12 |
| 182 | 600315 | 上海家化 | 15,000 | 641,250.00 | 0.12 |
| 183 | 600704 | 物产中大 | 121,100 | 621,243.00 | 0.11 |
| 184 | 600648 | 外高桥 | 42,500 | 578,000.00 | 0.11 |
| 185 | 601898 | 中煤能源 | 55,400 | 575,052.00 | 0.10 |
| 186 | 600901 | 江苏租赁 | 110,400 | 566,352.00 | 0.10 |
| 187 | 300244 | 迪安诊断 | 18,000 | 559,800.00 | 0.10 |
| 188 | 300482 | 万孚生物 | 13,400 | 545,514.00 | 0.10 |
| 189 | 300012 | 华测检测 | 23,200 | 538,472.00 | 0.10 |
| 190 | 002240 | 盛新锂能 | 8,800 | 531,168.00 | 0.10 |
| 191 | 002497 | 雅化集团 | 16,000 | 522,400.00 | 0.10 |
| 192 | 002244 | 滨江集团 | 60,000 | 519,000.00 | 0.09 |
| 193 | 002191 | 劲嘉股份 | 48,000 | 514,560.00 | 0.09 |
| 194 | 600392 | 盛和资源 | 22,600 | 510,760.00 | 0.09 |
| 195 | 603456 | 九洲药业 | 9,400 | 485,980.00 | 0.09 |
| 196 | 688122 | 西部超导 | 5,255 | 484,511.00 | 0.09 |
| 197 | 688099 | 晶晨股份 | 4,735 | 478,235.00 | 0.09 |
| 198 | 603613 | 国联股份 | 5,285 | 468,251.00 | 0.09 |
| 199 | 000519 | 中兵红箭 | 16,000 | 466,400.00 | 0.09 |
| 200 | 688777 | 中控技术 | 6,400 | 465,664.00 | 0.09 |
| 201 | 600909 | 华安证券 | 97,600 | 444,080.00 | 0.08 |
| 202 | 601456 | 国联证券 | 36,000 | 441,720.00 | 0.08 |
| 203 | 600177 | 雅戈尔 | 65,200 | 432,276.00 | 0.08 |
| 204 | 600867 | 通化东宝 | 41,600 | 430,144.00 | 0.08 |
| 205 | 002030 | 达安基因 | 25,000 | 429,750.00 | 0.08 |
| 206 | 603444 | 吉比特 | 1,075 | 417,100.00 | 0.08 |
| 207 | 600787 | 中储股份 | 73,200 | 416,508.00 | 0.08 |
| 208 | 002078 | 太阳纸业 | 33,800 | 416,078.00 | 0.08 |
| 209 | 601618 | 中国中冶 | 112,800 | 394,800.00 | 0.07 |
| 210 | 600580 | 卧龙电驱 | 26,600 | 383,572.00 | 0.07 |

| | | | | | |
|-----|--------|-------|--------|------------|------|
| 211 | 601098 | 中南传媒 | 39,500 | 372,880.00 | 0.07 |
| 212 | 603868 | 飞科电器 | 4,800 | 363,600.00 | 0.07 |
| 213 | 000559 | 万向钱潮 | 60,800 | 361,152.00 | 0.07 |
| 214 | 000786 | 北新建材 | 10,400 | 360,048.00 | 0.07 |
| 215 | 000553 | 安道麦 A | 29,200 | 353,612.00 | 0.06 |
| 216 | 600390 | 五矿资本 | 68,000 | 332,520.00 | 0.06 |
| 217 | 601555 | 东吴证券 | 47,200 | 327,096.00 | 0.06 |
| 218 | 688238 | 和元生物 | 12,836 | 325,007.52 | 0.06 |
| 219 | 600556 | 天下秀 | 36,000 | 296,280.00 | 0.05 |
| 220 | 002384 | 东山精密 | 12,600 | 288,918.00 | 0.05 |
| 221 | 000983 | 山西焦煤 | 21,200 | 283,868.00 | 0.05 |
| 222 | 002407 | 多氟多 | 5,600 | 273,896.00 | 0.05 |
| 223 | 603127 | 昭衍新药 | 2,400 | 273,120.00 | 0.05 |
| 224 | 002572 | 索菲亚 | 9,800 | 269,500.00 | 0.05 |
| 225 | 603345 | 安井食品 | 1,600 | 268,592.00 | 0.05 |
| 226 | 688322 | 奥比中光 | 8,529 | 264,313.71 | 0.05 |
| 227 | 600415 | 小商品城 | 47,200 | 262,904.00 | 0.05 |
| 228 | 000629 | 攀钢钒钛 | 68,800 | 261,440.00 | 0.05 |
| 229 | 600373 | 中文传媒 | 26,100 | 260,739.00 | 0.05 |
| 230 | 600566 | 济川药业 | 9,600 | 260,736.00 | 0.05 |
| 231 | 603198 | 迎驾贡酒 | 4,000 | 260,560.00 | 0.05 |
| 232 | 000563 | 陕国投 A | 82,000 | 255,840.00 | 0.05 |
| 233 | 000998 | 隆平高科 | 15,200 | 253,232.00 | 0.05 |
| 234 | 000970 | 中科三环 | 13,200 | 247,896.00 | 0.05 |
| 235 | 600582 | 天地科技 | 51,400 | 245,692.00 | 0.04 |
| 236 | 600863 | 内蒙华电 | 67,200 | 245,280.00 | 0.04 |
| 237 | 002299 | 圣农发展 | 12,600 | 241,668.00 | 0.04 |
| 238 | 000960 | 锡业股份 | 14,400 | 241,488.00 | 0.04 |
| 239 | 000988 | 华工科技 | 10,400 | 240,968.00 | 0.04 |
| 240 | 000997 | 新大陆 | 17,600 | 232,496.00 | 0.04 |
| 241 | 600597 | 光明乳业 | 18,400 | 232,392.00 | 0.04 |
| 242 | 603279 | 景津装备 | 7,360 | 228,233.60 | 0.04 |
| 243 | 688153 | 唯捷创芯 | 5,135 | 227,172.40 | 0.04 |
| 244 | 688819 | 天能股份 | 6,371 | 220,309.18 | 0.04 |
| 245 | 600572 | 康恩贝 | 49,600 | 219,728.00 | 0.04 |
| 246 | 300073 | 当升科技 | 2,400 | 216,816.00 | 0.04 |
| 247 | 001203 | 大中矿业 | 18,400 | 207,920.00 | 0.04 |
| 248 | 002268 | 卫士通 | 4,800 | 205,968.00 | 0.04 |
| 249 | 600765 | 中航重机 | 6,400 | 205,952.00 | 0.04 |
| 250 | 600745 | 闻泰科技 | 2,400 | 204,264.00 | 0.04 |
| 251 | 603267 | 鸿远电子 | 1,511 | 202,972.63 | 0.04 |
| 252 | 603233 | 大参林 | 6,320 | 197,816.00 | 0.04 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|--------|------------|------|
| 253 | 002507 | 涪陵榨菜 | 5,600 | 193,312.00 | 0.04 |
| 254 | 002624 | 完美世界 | 12,800 | 183,936.00 | 0.03 |
| 255 | 002557 | 洽洽食品 | 3,200 | 182,176.00 | 0.03 |
| 256 | 600039 | 四川路桥 | 16,800 | 176,904.00 | 0.03 |
| 257 | 002422 | 科伦药业 | 9,200 | 172,040.00 | 0.03 |
| 258 | 601872 | 招商轮船 | 28,800 | 165,888.00 | 0.03 |
| 259 | 600236 | 桂冠电力 | 27,200 | 165,648.00 | 0.03 |
| 260 | 000987 | 越秀金控 | 23,360 | 164,220.80 | 0.03 |
| 261 | 000738 | 航发控制 | 5,800 | 162,980.00 | 0.03 |
| 262 | 002128 | 电投能源 | 11,300 | 161,816.00 | 0.03 |
| 263 | 601016 | 节能风电 | 33,600 | 161,280.00 | 0.03 |
| 264 | 600673 | 东阳光 | 17,900 | 160,921.00 | 0.03 |
| 265 | 600282 | 南钢股份 | 49,600 | 156,240.00 | 0.03 |
| 266 | 000878 | 云南铜业 | 13,600 | 154,904.00 | 0.03 |
| 267 | 002878 | 元隆雅图 | 8,000 | 154,400.00 | 0.03 |
| 268 | 000581 | 威孚高科 | 8,000 | 154,000.00 | 0.03 |
| 269 | 600967 | 内蒙一机 | 16,800 | 153,216.00 | 0.03 |
| 270 | 601077 | 渝农商行 | 40,800 | 150,960.00 | 0.03 |
| 271 | 600639 | 浦东金桥 | 11,078 | 150,550.02 | 0.03 |
| 272 | 600167 | 联美控股 | 20,000 | 149,800.00 | 0.03 |
| 273 | 600970 | 中材国际 | 15,200 | 147,288.00 | 0.03 |
| 274 | 600073 | 上海梅林 | 18,400 | 146,648.00 | 0.03 |
| 275 | 000034 | 神州数码 | 9,600 | 146,112.00 | 0.03 |
| 276 | 002154 | 报喜鸟 | 33,600 | 145,152.00 | 0.03 |
| 277 | 601298 | 青岛港 | 26,400 | 144,408.00 | 0.03 |
| 278 | 600350 | 山东高速 | 27,200 | 142,800.00 | 0.03 |
| 279 | 600985 | 淮北矿业 | 9,600 | 139,776.00 | 0.03 |
| 280 | 300218 | 安利股份 | 9,600 | 136,992.00 | 0.03 |
| 281 | 300639 | 凯普生物 | 6,400 | 136,832.00 | 0.02 |
| 282 | 603128 | 华贸物流 | 13,600 | 136,408.00 | 0.02 |
| 283 | 002242 | 九阳股份 | 7,200 | 132,192.00 | 0.02 |
| 284 | 000937 | 冀中能源 | 17,400 | 129,804.00 | 0.02 |
| 285 | 000930 | 中粮科技 | 12,800 | 115,712.00 | 0.02 |
| 286 | 000778 | 新兴铸管 | 24,000 | 115,680.00 | 0.02 |
| 287 | 688150 | 莱特光电 | 5,626 | 110,269.60 | 0.02 |
| 288 | 601995 | 中金公司 | 2,400 | 106,776.00 | 0.02 |
| 289 | 002048 | 宁波华翔 | 6,400 | 102,528.00 | 0.02 |
| 290 | 000729 | 燕京啤酒 | 9,600 | 92,736.00 | 0.02 |
| 291 | 002396 | 星网锐捷 | 3,400 | 76,976.00 | 0.01 |
| 292 | 688283 | 坤恒顺维 | 1,595 | 72,428.95 | 0.01 |
| 293 | 600499 | 科达制造 | 3,200 | 66,048.00 | 0.01 |
| 294 | 600875 | 东方电气 | 4,000 | 65,800.00 | 0.01 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|--------|-----------|------|
| 295 | 000402 | 金融街 | 9,000 | 53,550.00 | 0.01 |
| 296 | 002372 | 伟星新材 | 2,000 | 48,080.00 | 0.01 |
| 297 | 600885 | 宏发股份 | 1,080 | 45,198.00 | 0.01 |
| 298 | 002948 | 青岛银行 | 10,400 | 37,648.00 | 0.01 |
| 299 | 601089 | 福元医药 | 1,749 | 36,816.45 | 0.01 |
| 300 | 002153 | 石基信息 | 2,280 | 36,183.60 | 0.01 |
| 301 | 601958 | 金铂股份 | 4,000 | 35,360.00 | 0.01 |
| 302 | 301236 | 软通动力 | 945 | 29,654.10 | 0.01 |
| 303 | 301206 | 三元生物 | 641 | 29,287.29 | 0.01 |
| 304 | 301201 | 诚达药业 | 353 | 25,253.62 | 0.00 |
| 305 | 301207 | 华兰疫苗 | 402 | 22,680.84 | 0.00 |
| 306 | 301109 | 军信股份 | 1,388 | 22,402.32 | 0.00 |
| 307 | 301263 | 泰恩康 | 682 | 21,401.16 | 0.00 |
| 308 | 301122 | 采纳股份 | 301 | 21,181.37 | 0.00 |
| 309 | 301219 | 腾远钴业 | 223 | 19,583.86 | 0.00 |
| 310 | 300834 | 星辉环材 | 635 | 19,069.05 | 0.00 |
| 311 | 301123 | 奕东电子 | 656 | 16,655.84 | 0.00 |
| 312 | 301103 | 何氏眼科 | 507 | 16,234.14 | 0.00 |
| 313 | 301212 | 联盛化学 | 416 | 13,844.48 | 0.00 |
| 314 | 301259 | 艾布鲁 | 483 | 12,046.02 | 0.00 |
| 315 | 301097 | 天益医疗 | 249 | 11,909.67 | 0.00 |
| 316 | 001268 | 联合精密 | 409 | 11,337.48 | 0.00 |
| 317 | 301196 | 唯科科技 | 271 | 10,167.92 | 0.00 |
| 318 | 301181 | 标榜股份 | 257 | 7,861.63 | 0.00 |
| 319 | 301228 | 实朴检测 | 373 | 7,586.82 | 0.00 |
| 320 | 301279 | 金道科技 | 296 | 6,751.76 | 0.00 |
| 321 | 603883 | 老百姓 | 60 | 2,032.80 | 0.00 |

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 本期累计买入金额 | 占期初基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------|---------------|----------------|
| 1 | 601318 | 中国平安 | 17,944,673.00 | 1.85 |
| 2 | 000002 | 万科A | 16,064,767.00 | 1.66 |
| 3 | 601668 | 中国建筑 | 14,996,712.00 | 1.55 |
| 4 | 600519 | 贵州茅台 | 13,926,594.00 | 1.44 |
| 5 | 601398 | 工商银行 | 13,550,223.00 | 1.40 |
| 6 | 002304 | 洋河股份 | 13,194,264.00 | 1.36 |
| 7 | 601688 | 华泰证券 | 12,640,203.00 | 1.30 |
| 8 | 601166 | 兴业银行 | 12,541,911.00 | 1.29 |
| 9 | 002624 | 完美世界 | 11,514,892.00 | 1.19 |
| 10 | 002271 | 东方雨虹 | 11,364,858.00 | 1.17 |

| | | | | |
|----|--------|------|---------------|------|
| 11 | 601989 | 中国重工 | 10,793,470.00 | 1.11 |
| 12 | 688012 | 中微公司 | 10,706,737.63 | 1.10 |
| 13 | 600426 | 华鲁恒升 | 10,634,932.18 | 1.10 |
| 14 | 300308 | 中际旭创 | 10,631,106.00 | 1.10 |
| 15 | 002714 | 牧原股份 | 10,609,232.80 | 1.09 |
| 16 | 600380 | 健康元 | 10,507,541.00 | 1.08 |
| 17 | 000776 | 广发证券 | 9,992,977.00 | 1.03 |
| 18 | 603259 | 药明康德 | 9,958,087.00 | 1.03 |
| 19 | 600919 | 江苏银行 | 9,536,758.00 | 0.98 |
| 20 | 600276 | 恒瑞医药 | 9,532,628.66 | 0.98 |

注：买入金额不包括相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 本期累计卖出金额 | 占期初基金资产净值比例(%) |
|----|--------|-------|---------------|----------------|
| 1 | 600519 | 贵州茅台 | 38,840,783.50 | 4.01 |
| 2 | 300750 | 宁德时代 | 20,550,234.00 | 2.12 |
| 3 | 601668 | 中国建筑 | 18,506,027.00 | 1.91 |
| 4 | 601318 | 中国平安 | 18,272,598.00 | 1.88 |
| 5 | 000333 | 美的集团 | 17,137,916.00 | 1.77 |
| 6 | 600048 | 保利发展 | 16,835,748.00 | 1.74 |
| 7 | 600919 | 江苏银行 | 15,458,725.50 | 1.59 |
| 8 | 002594 | 比亚迪 | 15,017,118.17 | 1.55 |
| 9 | 601688 | 华泰证券 | 14,707,772.00 | 1.52 |
| 10 | 600036 | 招商银行 | 14,481,990.66 | 1.49 |
| 11 | 601225 | 陕西煤业 | 14,298,152.00 | 1.47 |
| 12 | 600028 | 中国石化 | 14,137,344.00 | 1.46 |
| 13 | 000063 | 中兴通讯 | 13,788,279.00 | 1.42 |
| 14 | 002049 | 紫光国微 | 13,642,842.96 | 1.41 |
| 15 | 000069 | 华侨城 A | 13,550,360.00 | 1.40 |
| 16 | 601328 | 交通银行 | 13,333,062.00 | 1.38 |
| 17 | 601211 | 国泰君安 | 13,176,907.00 | 1.36 |
| 18 | 600438 | 通威股份 | 12,948,372.19 | 1.34 |
| 19 | 300059 | 东方财富 | 12,558,806.40 | 1.30 |
| 20 | 000568 | 泸州老窖 | 12,007,171.00 | 1.24 |

注：卖出金额不包括相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

| | |
|--------------|------------------|
| 买入股票成本（成交）总额 | 1,359,659,876.87 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 1,598,316,199.60 |

注：买入股票成本、卖出股票收入均不包括相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券品种 | 公允价值 | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|-----------|---------------|---------------|
| 1 | 国家债券 | 5,056,116.44 | 0.92 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 30,579,986.30 | 5.58 |
| | 其中：政策性金融债 | 30,579,986.30 | 5.58 |
| 4 | 企业债券 | - | - |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 可转债（可交换债） | 403,030.03 | 0.07 |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 36,039,132.77 | 6.58 |

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 数量（张） | 公允价值 | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|--------|----------|---------|---------------|---------------|
| 1 | 160407 | 16 农发 07 | 300,000 | 30,579,986.30 | 5.58 |
| 2 | 019666 | 22 国债 01 | 50,000 | 5,056,116.44 | 0.92 |
| 3 | 113060 | 浙 22 转债 | 4,030 | 403,030.03 | 0.07 |

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金主要运用股指期货合约进行套期保值操作，规避市场系统性风险。在完全套保的理念下，本基金根据股票多头组合的市值计算股指期货合约卖单量，并根据市场变化对股指期货合约卖单量进行动态跟踪并适时调整。同时，综合考虑定价关系、套利机会、流动性以及保证金要求等因素，在不同股指期货合约之间进行动态配置，并适时进行合约展期操作，以求提高组合收益和套期保值的效果。 本基金投资于股指期货，为特殊类型的混合型基金，主要采用追求绝对收益的市场中性策略，与股票市场表现的相关性较低。相对股票型基金和一般的混合型基金，其预期风险较小。本基金的投资符合既定的投资政策和投资目标。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金未投资国债期货。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金未投资国债期货。

7.12 市场中性策略执行情况

截至本报告期末,本基金持有股票资产 430,153,046.75 元,占基金资产净值的比例为 78.53%;运用股指期货进行对冲的空头合约市值-388,259,120.00 元,占基金资产净值的比例为-70.88%,空头合约市值占股票资产的比例为-90.26%。本报告期内,本基金执行市场中性策略的投资收益为-2,127,637.59 元,公允价值变动损益为-14,091,041.57 元。

7.13 投资组合报告附注

7.13.1 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

量化对冲混合基金截至 2022 年 6 月 30 日持仓前十名证券中的兴业银行(601166)的发行人兴业银行股份有限公司因违反信用信息采集、提供、查询及相关管理规定,于 2021 年 8 月 13 日收到中国人民银行处罚款 5 万元的行政处罚措施。

本基金管理人通过对上述上市公司进行进一步了解和视为,认为上述处分不会对公司的投资价值构成实质性影响,因此本基金管理人对上述证券的投资判断未发生改变。报告期内,本基金投资的前十名证券的其余九名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

7.13.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

7.13.3 期末其他各项资产构成

单位:人民币元

| 序号 | 名称 | 金额 |
|----|-------|---------------|
| 1 | 存出保证金 | 47,868,654.09 |
| 2 | 应收清算款 | 9,691,743.12 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | 49,884.53 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 57,610,281.74 |

7.13.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.13.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.13.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，合计数可能不等于分项之和。

§ 8 基金份额持有人信息**8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构**

份额单位：份

| 份额级别 | 持有人户数 (户) | 户均持有的基金份额 | 持有人结构 | | | |
|------------|-----------|-----------|----------------|------------|----------------|------------|
| | | | 机构投资者 | | 个人投资者 | |
| | | | 持有份额 | 占总份额比例 (%) | 持有份额 | 占总份额比例 (%) |
| 华宝量化对冲混合 A | 31,613 | 6,157.93 | 135,190,634.54 | 69.45 | 59,480,104.34 | 30.55 |
| 华宝量化对冲混合 C | 88,863 | 3,229.70 | 15,093,138.88 | 5.26 | 271,907,662.14 | 94.74 |
| 合计 | 120,476 | 3,998.07 | 150,283,773.42 | 31.20 | 331,387,766.48 | 68.80 |

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目 | 份额级别 | 持有份额总数 (份) | 占基金总份额比例 (%) |
|------------------|------------|------------|--------------|
| 基金管理人所有从业人员持有本基金 | 华宝量化对冲混合 A | 338,357.88 | 0.1738 |
| | 华宝量化对冲混合 C | 194,812.29 | 0.0679 |
| | 合计 | 533,170.17 | 0.1107 |

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

| 项目 | 份额级别 | 持有基金份额总量的数量区间 (万份) |
|-------------------------------|------------|--------------------|
| 本公司高级管理人员、基金投资和研究人员、部门负责人持有本开 | 华宝量化对冲混合 A | 10~50 |
| | 华宝量化对冲混合 C | 0~10 |

| | | |
|---------------------|------------|-------|
| 开放式基金 | | |
| | 合计 | 10~50 |
| 本基金基金经理持有 本开放式基金 | 华宝量化对冲混合 A | 10~50 |
| | 华宝量化对冲混合 C | 0 |
| | 合计 | 10~50 |

8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

| 项目 | 持有份额总数 | 持有份额占基金总份额比例 (%) | 发起份额总数 | 发起份额占基金总份额比例 (%) | 发起份额承诺持有期限 |
|-------------|------------|------------------|---------------|------------------|------------|
| 基金管理人固有资金 | - | - | 9,800,000.00 | 2.03 | 不少于 3 年 |
| 基金管理人高级管理人员 | 117,860.68 | 0.02 | 100,000.00 | 0.02 | 不少于 3 年 |
| 基金经理等人员 | 110,000.63 | 0.02 | 100,000.00 | 0.02 | 不少于 3 年 |
| 基金管理人股东 | - | - | - | - | - |
| 其他 | - | - | - | - | - |
| 合计 | 227,861.31 | 0.05 | 10,000,000.00 | 2.08 | - |

注：1、本基金募集期间，本基金管理人运用固有资金、基金管理人高级管理人员及基金经理等人员使用自有资金作为发起资金总计 1,000 万元认购了本基金。发起资金认购的基金份额自基金合同生效之日起持有期不少于 3 年；

2、本基金管理人运用固有资金于 2014 年 9 月 12 日通过本公司直销柜台认购本基金作为发起资金的认购费用为 1,000 元；本基金管理人高级管理人员使用自有资金认购本基金作为发起资金的认购费率为 0.3%；本基金基金经理等人员使用自有资金认购本基金作为发起资金的认购费率为 0.6%。符合基金合同和招募说明书等法律文件的约定。

3、发起份额已满足承诺持有期限，管理人于 2021 年四季度赎回本基金全部发起式份额。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目 | 华宝量化对冲混合 A | 华宝量化对冲混合 C |
|--|----------------|---------------|
| 基金合同生效日 (2014 年 9 月 17 日) 基金份额总额 | 539,601,058.43 | 67,437,011.52 |

| | | |
|---------------|----------------|----------------|
| 本报告期期初基金份额总额 | 371,672,758.22 | 466,002,488.72 |
| 本报告期基金总申购份额 | 1,950,985.70 | 6,712,440.55 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 178,953,005.04 | 185,714,128.25 |
| 本报告期基金拆分变动份额 | - | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 194,670,738.88 | 287,000,801.02 |

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、基金管理人的重大人事变动

2022 年 4 月 18 日，基金管理人发布高级管理人员变更公告，XIAOYI HELEN HUANG（黄小意）不再担任公司总经理，公司副总经理向辉代为履行总经理职责。

2、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，无涉及本基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及基金管理人、基金财产和基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未发生变更。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

基金管理人为本基金聘任的会计师事务所向本基金提供的审计服务持续期限为：本基金合同生效之日起至本报告期末。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人、托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 交易单元数量 | 股票交易 | | 应支付该券商的佣金 | | 备注 |
|------|--------|----------------|------------------|------------|----------------|----|
| | | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例 (%) | 佣金 | 占当期佣金总量的比例 (%) | |
| 方正证券 | 1 | 451,491,327.12 | 15.33 | 413,446.84 | 15.23 | - |
| 华安证券 | 2 | 402,030,347.03 | 13.65 | 374,411.69 | 13.79 | - |
| 国海证券 | 2 | 266,651,097.22 | 9.05 | 244,493.28 | 9.01 | - |
| 东方财富 | 2 | 261,096,604.35 | 8.86 | 242,473.71 | 8.93 | - |
| 宏信证券 | 2 | 255,798,546.64 | 8.68 | 233,873.32 | 8.61 | - |
| 中金国际 | 2 | 235,781,972.67 | 8.01 | 215,934.09 | 7.95 | - |
| 东北证券 | 2 | 205,386,383.11 | 6.97 | 191,275.36 | 7.05 | - |
| 开源证券 | 2 | 200,021,127.51 | 6.79 | 182,279.89 | 6.71 | - |
| 信达证券 | 2 | 104,112,932.08 | 3.53 | 96,960.51 | 3.57 | - |
| 光大证券 | 2 | 76,855,076.68 | 2.61 | 70,037.99 | 2.58 | - |
| 申万宏源 | 3 | 75,752,005.87 | 2.57 | 70,547.98 | 2.60 | - |
| 浙商证券 | 2 | 72,591,406.67 | 2.46 | 67,475.19 | 2.49 | - |
| 广发证券 | 2 | 70,396,711.87 | 2.39 | 64,855.71 | 2.39 | - |
| 东吴证券 | 2 | 59,415,751.28 | 2.02 | 54,633.98 | 2.01 | - |
| 东方证券 | 1 | 58,415,194.60 | 1.98 | 53,243.11 | 1.96 | - |
| 中信建投 | 2 | 49,444,843.00 | 1.68 | 46,047.95 | 1.70 | - |
| 江海证券 | 2 | 44,425,747.43 | 1.51 | 41,373.92 | 1.52 | - |
| 长江证券 | 1 | 28,413,195.51 | 0.96 | 26,461.45 | 0.97 | - |
| 国金证券 | 2 | 12,155,566.03 | 0.41 | 11,077.21 | 0.41 | - |
| 天风证券 | 3 | 7,465,269.11 | 0.25 | 6,803.10 | 0.25 | - |
| 招商证券 | 1 | 4,497,129.00 | 0.15 | 4,143.23 | 0.15 | - |
| 上海证券 | 2 | 2,619,661.30 | 0.09 | 2,387.27 | 0.09 | - |
| 国信证券 | 1 | 554,656.50 | 0.02 | 516.53 | 0.02 | - |
| 国联证券 | 3 | 29,084.66 | 0.00 | 26.78 | 0.00 | - |
| 安信证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 财通证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 诚通证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 大和证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 德邦证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 国泰君安 | 1 | - | - | - | - | - |
| 国元证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 海通证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 华宝证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 华创证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 华金证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 民生证券 | 2 | - | - | - | - | - |

| | | | | | | |
|------|---|---|---|---|---|---|
| 兴业证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 英大证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 中泰证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中信金通 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中信证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中银国际 | 2 | - | - | - | - | - |

注：1、基金管理人选择交易单元的标准和程序如下：

(1) 选择标准：资质雄厚，信誉良好，注册资本不少于 5 亿元人民币；财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；经营行为规范，最近两年未因重大违规行为受到中国证监会和中国人民银行处罚；内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；具备基金运作所需要的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本基金进行证券交易的需 要，并能为本基金提供全面的信息服 务；研究实力较强，有固定的研究机构和专门的研究人 员，能及时为本基金提供高质量的咨询服务，并能根据基金投资的特定要求，提供专门研究报告；适当的地域分散化。

(2) 选择程序：(a) 服务评价；(b) 拟定备选交易单元；(c) 签约。

2、本报告期租用的证券公司交易单元新增的有：英大证券、大和证券。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 债券交易 | | 债券回购交易 | | 权证交易 | |
|------|--------------|------------------|------------------|--------------------|------|------------------|
| | 成交金额 | 占当期债券成交总额的比例 (%) | 成交金额 | 占当期债券回购成交总额的比例 (%) | 成交金额 | 占当期权证成交总额的比例 (%) |
| 方正证券 | 4,420,879.36 | 11.56 | 335,215,000.00 | 10.48 | - | - |
| 华安证券 | 234,240.00 | 0.61 | 2,042,073,000.00 | 63.86 | - | - |
| 国海证券 | - | - | - | - | - | - |
| 东方财富 | - | - | 55,000,000.00 | 1.72 | - | - |
| 宏信证券 | - | - | - | - | - | - |
| 中金国际 | - | - | - | - | - | - |
| 东北证券 | - | - | 9,900,000.00 | 0.31 | - | - |
| 开源证券 | - | - | 24,000,000.00 | 0.75 | - | - |
| 信达证券 | 859,933.20 | 2.25 | 66,900,000.00 | 2.09 | - | - |
| 光大证券 | - | - | - | - | - | - |
| 申万宏源 | - | - | 319,100,000.00 | 9.98 | - | - |
| 浙商证券 | - | - | 91,000,000.00 | 2.85 | - | - |
| 广发证券 | - | - | - | - | - | - |

| | | | | | | |
|------|---------------|-------|---------------|------|---|---|
| 东吴证券 | - | - | 29,756,000.00 | 0.93 | - | - |
| 东方证券 | - | - | - | - | - | - |
| 中信建投 | 17,680,343.94 | 46.23 | 53,200,000.00 | 1.66 | - | - |
| 江海证券 | - | - | 96,900,000.00 | 3.03 | - | - |
| 长江证券 | - | - | 17,083,000.00 | 0.53 | - | - |
| 国金证券 | - | - | - | - | - | - |
| 天风证券 | - | - | - | - | - | - |
| 招商证券 | - | - | - | - | - | - |
| 上海证券 | - | - | - | - | - | - |
| 国信证券 | 15,052,602.73 | 39.36 | 30,100,000.00 | 0.94 | - | - |
| 国联证券 | - | - | - | - | - | - |
| 安信证券 | - | - | - | - | - | - |
| 财通证券 | - | - | - | - | - | - |
| 诚通证券 | - | - | - | - | - | - |
| 大和证券 | - | - | - | - | - | - |
| 德邦证券 | - | - | - | - | - | - |
| 国泰君安 | - | - | 27,600,000.00 | 0.86 | - | - |
| 国元证券 | - | - | - | - | - | - |
| 海通证券 | - | - | - | - | - | - |
| 华宝证券 | - | - | - | - | - | - |
| 华创证券 | - | - | - | - | - | - |
| 华金证券 | - | - | - | - | - | - |
| 民生证券 | - | - | - | - | - | - |
| 兴业证券 | - | - | - | - | - | - |
| 英大证券 | - | - | - | - | - | - |
| 中泰证券 | - | - | - | - | - | - |
| 中信金通 | - | - | - | - | - | - |
| 中信证券 | - | - | - | - | - | - |
| 中银国际 | - | - | - | - | - | - |

10.8 其他重大事件

| 序号 | 公告事项 | 法定披露方式 | 法定披露日期 |
|----|---|---------------|------------|
| 1 | 华宝量化对冲策略混合型发起式证券投资基金 2021 年第 4 季度报告 | 基金管理人网站 | 2022-01-24 |
| 2 | 华宝基金关于旗下部分基金增加招商银行招赢通为销售平台并参加招商银行招赢通平台费率优惠活动的公告 | 基金管理人网站, 证券时报 | 2022-03-23 |

| | | | |
|----|--|-----------------------------------|------------|
| 3 | 华宝量化对冲策略混合型发起式证券投资基金（C类份额）基金产品资料概要（更新） | 基金管理人网站 | 2022-03-29 |
| 4 | 华宝量化对冲策略混合型发起式证券投资基金（A类份额）基金产品资料概要（更新） | 基金管理人网站 | 2022-03-29 |
| 5 | 华宝量化对冲策略混合型发起式证券投资基金招募说明书（更新） | 基金管理人网站 | 2022-03-29 |
| 6 | 华宝量化对冲策略混合型发起式证券投资基金 2021 年年度报告 | 基金管理人网站 | 2022-03-31 |
| 7 | 华宝量化对冲策略混合型发起式证券投资基金 2022 年第 1 季度报告 | 基金管理人网站 | 2022-04-22 |
| 8 | 华宝基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加上海攀赢基金销售有限公司为代销机构及费率优惠的公告 | 基金管理人网站, 上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报 | 2022-05-24 |
| 10 | 华宝基金关于旗下部分基金新增华林证券为代销机构的公告 | 基金管理人网站, 上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报 | 2022-06-21 |

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

| 投资者类别 | 报告期内持有基金份额变化情况 | | | | | 报告期末持有基金情况 | |
|-------|----------------|-------------------------|----------------|------|---------------|---------------|----------|
| | 序号 | 持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间 | 期初份额 | 申购份额 | 赎回份额 | 持有份额 | 份额占比 (%) |
| 机构 | 1 | 20220101~20220112 | 169,203,891.70 | 0.00 | 80,000,000.00 | 89,203,891.70 | 18.52 |

产品特有风险

报告期内本基金出现单一投资者持有基金份额比例超过 20%的情况。在单一投资者持有基金份额比例较高的情况下,如该投资者集中赎回,可能会增加基金的流动性风险。此外,由于基金在遇到大额赎回的时候可能需要变现部分资产,可能对持有资产的价格形成冲击,增加基金的市场风险。基金管理人将专业审慎、勤勉尽责地运作基金资产,加强防范流动性风险、市场风险,保护持有人利益。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本公司于 2022 年 5 月完成工商变更登记,公司变更后的股东信息为:华宝信托有限责任公司(持股 51%)、Warburg Pincus Asset Management, L.P. (“华平投资”,持股 29%)、

江苏省铁路集团有限公司（持股 20%）。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

中国证监会批准基金设立的文件；
华宝量化对冲策略混合型发起式证券投资基金基金合同；
华宝量化对冲策略混合型发起式证券投资基金招募说明书；
华宝量化对冲策略混合型发起式证券投资基金托管协议；
基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程；
基金管理人报告期内在指定报刊上披露的各种公告；
基金托管人业务资格批件和营业执照。

12.2 存放地点

以上文件存于基金管理人及基金托管人办公住所备投资者查阅。

12.3 查阅方式

投资者可以通过基金管理人网站，查阅或下载基金合同、招募说明书、托管协议及基金的各种定期和临时公告。

华宝基金管理有限公司

2022 年 8 月 31 日